

## Vorvertragliche Informationen zu Finanzprodukten, die nicht unter Artikel 8 Absatz 1 oder Artikel 9 Absatz 1, 2 oder 3 der Verordnung (EU) 2019/2088 fallen

Stand: 20.02.2024

Name des Produkts: 135,3% WertSchutz Zertifikat auf den VK Globale Aktien 12% Risikokontrolle Index

Emittentin: Barclays Bank PLC (G5GSEF7VJP5I7OUK5573)

### Keine ökologischen oder sozialen Merkmale und Ziele

#### Erläuterungen

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält.

**Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.**

#### Werden mit diesem Finanzprodukt ökologisch und/oder soziale Merkmale beworben?

Das Zertifikat ist weder ganz noch teilweise dazu bestimmt, gegenwärtige oder zukünftige „ESG“, „grüne“, „nachhaltige“, „klimafreundliche“ oder ähnlich gekennzeichnete Rahmenwerke, Taxonomien, Standards und/oder andere damit zusammenhängende regulierte Richtlinien zu erfüllen

#### Hat dieses Finanzprodukt ein nachhaltiges Anlageziel?

Dieses Zertifikat weist kein nachhaltiges Anlageziel auf. Es wird von der Emittentin Barclays Bank PLC emittiert und die Auszahlung ist an den VK Globale Aktien 12% Risikokontrolle Index gebunden.

Die Verwendung eines weit überwiegenden Teils der Erlöse aus dem Zertifikat dient dem allgemeinen Refinanzierungszweck der Barclays Bank PLC und hat folglich kein dediziertes nachhaltiges Anlageziel. Von einem kleinen Teil der Erlöse erwirbt die Emittentin eine Kaufoption auf den Basiswert, VK Globale Aktien 12% Risikokontrolle Index. Über diese Kaufoption erfolgt eine Partizipation an der Wertentwicklung des Basiswerts. Es erfolgt keine direkte Investition in die in dem Basiswert enthaltenen Aktien.

Der VK Globale Aktien 12% Risikokontrolle Index berücksichtigt Umwelt- und Sozialaspekte in Form von Ausschlusskriterien. Das ganzheitliche Finanzprodukt in Form des Zertifikats hat jedoch kein nachhaltiges Anlageziel und wird als Artikel 6 Produkt vermarktet. Auch wenn das Zertifikat keine nachhaltigen Anlageziele aufweist, können die Inhaber von einer potenziell positiven Wertentwicklung der nach Nachhaltigkeitskriterien ausgewählten Aktien im Index profitieren. Die Anlage ist jedoch nicht auf ein nachhaltiges Anlageziel ausgerichtet.

#### Wie werden Nachhaltigkeitsrisiken bei den Investitionsentscheidungen einbezogen?

Nachfolgend finden Sie Informationen darüber, wie Nachhaltigkeitsrisiken bei der Verwendung der Erlöse (allgemeiner Refinanzierungszweck von Barclays Bank PLC) und bei der Auswahl der Aktien im Basiswert berücksichtigt werden:

##### Barclays Gruppe<sup>[1]</sup>:

Die Nachhaltigkeitsstrategie der Barclays Gruppe gilt für die Barclays Bank PLC und ihrer Tochtergesellschaften und konzentriert sich auf den folgenden ökologischen Säulen:

- i) Erreichen von Netto-Null-Emissionen für alle unsere direkten und indirekten Emissionen bis 2050;
- ii) Ausbau der grünen und nachhaltigen Finanzierungstätigkeiten; und
- iii) Austausch mit unseren Kunden und Prüfung der Sektoren mit den höchsten Emissionen, einschließlich Energie, Strom, Zement, Stahl, Automobilbau sowie Wohnimmobilien

Die Barclays Gruppe hat sich das Ziel gesetzt, zwischen 2023 und 2030 eine Billion USD für die Nachhaltigkeits- und Übergangs-Finanzierung bereitzustellen. Als Teil ihres Portfolios an Kapital mit nachhaltiger Wirkung hat die Barclays Gruppe bis 2027 Eigenkapital in Höhe von 500 Millionen GBP für Start-ups im Bereich der

Klimatechnologie bereitgestellt, was dazu beiträgt, den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft zu beschleunigen.

Die Barclays Gruppe zielt darauf ab, die absoluten CO<sub>2</sub>- und Methan-Emissionen im Energieportfolio um 40 % zu reduzieren und die CO<sub>2</sub>e-Intensität in ihrem Energieportfolio bis 2030 im Vergleich zu 2020 um 50-69 % zu reduzieren. Darüber hinaus hat sich die Barclays Gruppe verpflichtet, die CO<sub>2</sub>e-Intensität aus ihrem Zementportfolio um 20-26 % und die CO<sub>2</sub>e-Intensität aus dem Stahlportfolio bis 2030 gegenüber dem Ausgangswert 2021 um 20-40 % zu reduzieren. Zwei neue Sektoren wurden unserer Referenz für finanzierte Emissionen mit einem Basisjahr 2022 hinzugefügt: Automobilbau sowie Wohnimmobilien. Barclays hat für diese Sektoren ein Intensitätsreduktionsziel von 40% bis 64% bzw. 40% bis 2030.

Um das Ziel, bis 2050 „Netto-Null“ zu sein, zu unterstützen, wurde die Barclays Gruppe 2021 Mitglied der Net-Zero Banking Alliance, die Teil der Glasgow Financial Alliance for Net Zero ist.<sup>[2]</sup>

Die Barclays Gruppe ist auch Mitglied der Partnership for Carbon Accounting Financials und unterstützt die Entwicklung des Global Carbon Accounting Standards. Im Jahr 2021 leitete die Barclays Gruppe eine Kapitalmarkt-Arbeitsgruppe von sechs globalen Banken, die eine Methodik entwickeln, um die Emissionen im Zusammenhang mit den Aktivitäten der Banken bei Kapitalmarkttransaktionen zu berücksichtigen. Im September 2019 schloss sich die Barclays Gruppe 16 anderen Banken bei der Durchführung der Bewertung des Kapitalübergangs nach dem Übereinkommen von Paris an. Die Barclays Gruppe ist auch Mitglied der Financing a Just Transition Alliance, die vom Grantham Research Institute an der London School of Economics and Political Science geleitet wird, um Aktivitäten für einen gerechten Übergang zu erleichtern und zu unterstützen. Die Barclays Gruppe ist im September 2019 den Principles for Responsible Banking im Rahmen der Finanzinitiative des Umweltprogramms der Vereinten Nationen beigetreten und ist seit 2017 Unterzeichner der Taskforce on Climate-related Financial Disclosures des Financial Stability Board.

#### **Aktienwahl im VK Globale Aktien 12% Risikokontrolle Index**

Der VK Globale Aktien 12% Risikokontrolle Index ist eine risikokontrollierte Version des Parent-Underlying VK Globale Aktien. Der Parent-Underlying ist ein proprietärer Index, der von Barclays erstellt und verwaltet wird und auf einem proprietären Anlageprozess zur Vermögensallokation basiert, der von dem Indexselektionsbeauftragten durchgeführt wird. Es gibt eine aktive dynamische Allokation zwischen den verschiedenen Vermögenswerten, einem Korb einzelner Aktien aus den wichtigen Industrieländern (die Bestandteile). Der Indexselektionsbeauftragte wählt Unternehmen aus einem vorab geprüften Universum globaler Aktien aus, die vereinbar sind mit

- (i) einer Mindestmarktkapitalisierung und täglichen Liquiditätsvorgaben
- (ii) den globalen Auswirkungskriterien der Vereinten Nationen
- (iii) der Nichtbeteiligung an kontroversen Geschäften
- (iv) dem Ausschluss von 30% der Unternehmen mit den schlechtesten ESG-Risikowerten je Sektor
- (v) dem Ausschluss von Unternehmen mit einem hohen oder ernsten ESG-Risikowert über einem Schwellenwert von 30.

Der Indexselektionsbeauftragte kann zusätzliche Filter und Zulassungskriterien anwenden, um die Bestandteile auszuwählen. Die als Bestandteile ausgewählten Unternehmen werden im Allgemeinen vierteljährlich überprüft und neu gewichtet, obwohl eine häufigere Neugewichtung möglich ist, wie von dem Indexselektionsbeauftragten im Rahmen vordefinierter Anlagerichtlinien festgelegt.

<sup>[1]</sup> <https://home.barclays/content/dam/home-barclays/documents/investor-relations/ResultAnnouncements/H12023Results/Barclays-H123-ESG-Investor-Presentation.pdf>

<sup>[2]</sup> <https://www.unepfi.org/member/barclays-group-plc/>

**Ein Nachhaltigkeitsrisiko** ist gemäß Art. 2 Nr. 22 der Verordnung (EU) 2019/2088 ein Ereignis oder eine Bedingung in den Bereichen Umwelt, Soziales oder Unternehmensführung, dessen beziehungsweise deren Eintreten tatsächlich oder potenziell wesentliche negative Auswirkungen auf den Wert der Investition haben könnte

#### **Was sind die Anlagerichtlinien für die Auswahl der Kapitalanlagen?**

Nicht anwendbar auf dieses Produkt.

#### **Wie werden die zu erwartenden Auswirkungen von Nachhaltigkeitsrisiken auf die Rendite des Produktes bewertet?**

Nicht anwendbar auf dieses Produkt. Es findet keine Bewertung statt.

#### **Wie wirken sich die zu erwartenden Auswirkungen von Nachhaltigkeitsrisiken auf die Rendite der Finanzprodukte aus?**

Nicht anwendbar auf dieses Produkt. Es findet keine Bewertung statt.



**Werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Nicht anwendbar auf dieses Produkt. Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren werden nicht berücksichtigt.