

## Vorvertragliche Informationen

zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

**Swisscanto (LU) Portfolio Fund Committed Balance (EUR)**

Unternehmenskennung (LEI-Code):

**549300BVWREIUPX2DR18**

Version:

**Juli 2026**

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. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wird damit ein Mindestanteil an **nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_\_\_%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind.

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind.

Es wird damit ein Mindestanteil an **nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_\_\_%

Es werden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt werden, enthält es einen Mindestanteil von 20% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind.

mit einem sozialen Ziel.

Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



## **Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?**

Der Teilfonds verfolgt eine Anlagestrategie unter Berücksichtigung von ökologischen und sozialen Merkmalen. Diese Merkmale umfassen Ausschlüsse, die im Anlageprozess angewandte ESG-Integration, Ausrichtung auf die Reduktion der CO<sub>2</sub>e-Intensität (Klima-Ausrichtung) sowie nachhaltige Investitionen.

### ● **Welche Nachhaltigkeitsindikatoren werden zur Messung der Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale, die durch dieses Finanzprodukt beworben werden, herangezogen?**

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Das Asset Management nutzt eine Vielzahl von Datenpunkten, um die Bemessung der beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale durchführen zu können. Dabei stützt es sich auf Daten von unabhängigen Drittanbietern sowie auf eigene qualitative und quantitative Analysen.

Nachfolgende in die Anlageprozesse integrierte Nachhaltigkeitsindikatoren werden zur Bemessung des Erreichens der beworbenen Merkmale herangezogen:

#### **1. Ausschlüsse**

Anhand von Ausschlusskriterien identifiziert das Asset Management ein erhöhtes Risiko der Verletzung von ökologischen und sozialen Werten. Gleichzeitig bedient es sich dieser Ausschlusskriterien, um ein Anlageuniversum zu erstellen, welches gezielter auf Anlagen ausgerichtet ist, die in Einklang mit diesen Werten stehen.

Folgende Aktivitäten/ Kriterien führen dabei bei Unternehmen zu einem Ausschluss:

- Herstellung von Waffen und Munition, einschliesslich folgender geächteter Waffen:
  - Streubomben und -munition
  - Antipersonen- und Landminen
  - Biologische und chemische Waffen
  - Atomwaffen Systeme
  - Atomwaffen Material
  - Angereichertes Uran
  - Blendlaser-Waffen
  - Brandwaffen
- Herstellung von Kriegstechnik (> 5% Umsatz)
- verhaltensbasierte Ausschlüsse u.a. gemäss Liste des Schweizer Vereins für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen
- UN Global Compact Verstösse \*
- Ausbeuterische Kinderarbeit
- Herstellung von Pornografie
- Förderung von Kohle (ex Metallproduktion; > 5% Umsatz) \*\*
- Kohlereserven (ex Metallproduktion) \*\*

Die Ausschlüsse von Staatsanleihen werden in Anlehnung an den Schweizer Vereins für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen durchgeführt. Zum aktuellen Zeitpunkt werden folgende Länder ausgeschlossen:

- Afghanistan
- Weissrussland
- Iran

- Libyen
- Myanmar
- Nordkorea
- Russland
- Sudan
- Südsudan
- Syrien
- Venezuela
- Simbabwe

Ferner behält sich das Asset Management vor, aus geschäftspolitischen Gründen weitere Staaten auszuschliessen.

- \* Bei Verstössen von Unternehmen gegen die UN Global Compact-Prinzipien (Norm der Vereinten Nationen (UN) zu Menschen- und Arbeitsrechten, Umweltstandards und Korruptionsbekämpfung), die ein Screening auf Basis von Daten eines externen Datenanbieters hervorbringt, sucht das Asset Management, falls dies als geeignet erachtet wird, im Rahmen eines Engagements den Dialog und fordert die Unternehmen dazu auf, ihr Verhalten zu ändern. Tritt innert angemessener Zeit keine Änderung des Verhaltens ein, werden bestehende Anlagen veräussert. Dies geschieht auch dann, wenn ein Dialog im Hinblick auf die Schwere des Verstosses als nicht geeignet angesehen wird.
- \*\* Green Bonds und Sustainability Bonds müssen nicht ausgeschlossen werden. Bei einem Green Bond und bei einem Sustainability Bond muss der Emittent die durch die Emission des Green bzw. Sustainability Bonds beschafften finanziellen Mittel zweckgebunden verwenden. Green Bonds dienen dabei der Kapitalbeschaffung für spezifische Aktivitäten zur Verringerung bzw. Verhinderung von negativen Auswirkungen auf die Umwelt. Sustainability Bonds dienen ebenfalls der Kapitalbeschaffung für spezifische Aktivitäten zur Verringerung bzw. Verhinderung von negativen Auswirkungen auf die Umwelt sowie zusätzlich auch der Kapitalbeschaffung für spezifische Aktivitäten zur Verringerung bzw. Verhinderung von negativen Auswirkungen auf die Gesellschaft.

## **2. ESG-Integration**

Mit der Absicht, Chancen und Risiken vor dem Anlageentscheid zu erkennen, integriert das Asset Management ökologische (E), soziale (S) und Governance (G) Faktoren (ESG-Integration) von Unternehmungen und Staaten in den Anlageprozess. Die Bewertung der Nachhaltigkeit einer Unternehmung bzw. eines Staates hinsichtlich ESG-Faktoren wird vom Vermögensverwalter anhand von proprietären ESG-Scores bemessen. Diese Scores werden anhand von eigenen Methoden auf Grundlage von Daten von unabhängigen Drittanbietern sowie auf Basis eigener qualitativer und quantitativer Analysen errechnet und bemessen.

## **3. Klima-Ausrichtung**

Das Asset Management richtet die Anlagetätigkeit darüber hinaus auf eine kontinuierliche Reduktion der CO<sub>2</sub>e-Intensität der Anlagen gemäss Pariser Klimaabkommen aus.

Die CO<sub>2</sub>e-Intensitäten sind bei Unternehmungen definiert als CO<sub>2</sub>e-Ausstoss im Verhältnis zum Umsatz (Tonnen CO<sub>2</sub>e pro Million US-Dollar Umsatz) und bei

Staatspapieren als CO<sub>2</sub>e-Ausstoss im Verhältnis zur volkswirtschaftlichen Wertschöpfung (Tonnen CO<sub>2</sub>e pro Million US-Dollar Bruttoinlandprodukt). Es werden Treibhausgase mit Erderwärmungswirkung nach Massgabe des internationalen Standards "Greenhouse Gas Protocol" (GHG-Protokoll) miteinbezogen (gemessen in CO<sub>2</sub>-Äquivalenten; CO<sub>2</sub>e). Für die Bestimmung der CO<sub>2</sub>e-Intensitäten werden Daten von unabhängigen Dritten verwendet. Gestützt auf diese Daten berechnet das Asset Management die massgeblichen CO<sub>2</sub>e-Intensitäten, die der Datenverfügbarkeit und Datenqualität allfälligen methodologischen Diskrepanzen und Spezialfällen Rechnung tragen.

#### **4. Nachhaltige Investitionen**

Das Asset Management investiert auch in Titel von Unternehmungen und zweckgebundene Finanzierungen (zum Beispiel Social, Green oder Sustainable Bonds), die gemäss seiner Einschätzung einen Beitrag zur Erfüllung von Nachhaltigkeitszielen mit Bezug zu einem oder mehreren der Nachhaltigkeitsziele der Vereinten Nationen (UN Sustainable Development Goals, im Folgenden „SDGs“) oder gleichwertigen Nachhaltigkeitszielen leisten (im Sinne des Artikel 2 (17) SFDR). Dabei werden Produkte und Dienstleistungen von Unternehmen (anhand des Umsatzanteils), die nachhaltige Wirtschaftsweisen oder die nachhaltigen Wertschöpfungsketten von Unternehmungen sowie Staaten und zweckgebundene Finanzierungen qualitativ und quantitativ untersucht.

Anlagen, die den unter Ziffern 1-2 und 4 beschriebenen Merkmalen nicht mehr entsprechen, werden innert angemessener Frist im Portfolio ersetzt. Erfüllt ein Teilfonds, die unter Ziffer 3 beschriebenen Merkmale nicht mehr, passt das Asset Management das Portfolio durch Veränderung der Titelgewichte oder durch den Ersatz von Titeln mit tieferen CO<sub>2</sub>e-Intensitäten entsprechend den jährlichen Zielvorgaben an. Das Asset Management stellt sicher, dass der entsprechende Richtwert im Schnitt über das Jahr eingehalten wird.

Der Teilfonds nutzt keinen Referenzindex zur Bemessung der dargestellten ökologischen und sozialen Merkmale.

- ***Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

Das Asset Management fokussiert sich mit einer Analyse zu nachhaltigen Anlagen auf Titel, die gemäss seiner Einschätzung einen positiven Beitrag zur Erfüllung von SDGs oder gleichwertigen Nachhaltigkeitszielen leisten. Dieser Beitrag kann hinsichtlich Produkte und Dienstleistungen, nachhaltiger Wirtschaftsweisen oder nachhaltiger Wertschöpfungsketten von Unternehmen erzielt werden. Staaten qualifizieren sich durch ein überdurchschnittliches Nachhaltigkeitsrating.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen**

handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

**Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigt nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Principal Adverse Impacts (im Folgenden: „PAIs“)). Zu diesem Zweck werden die obligatorischen Indikatoren aus Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 (im Folgenden "Anhang 1 der Verordnung (EU) 2019/2088") zugrunde gelegt. Emittenten, die das Asset Management gemäss PAIs als besonders schädlich einstuft, werden nicht zu den nachhaltigen Anlagen gezählt.

Wie stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Bei der Anlageanalyse für nachhaltige Investitionen werden die folgenden Normverletzungen berücksichtigt: Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC), die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte (UNGP) und das Übereinkommen der Internationalen Arbeitsorganisation (ILO). Schwerwiegende Verstöße gegen diese Normen führen dazu, dass allfällige nachhaltige Investitionen des Emittenten nicht berücksichtigt werden.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.*

*Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.*

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



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

- Ja,  
der Teilfonds berücksichtigt nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (PAIs). Hierzu werden die verpflichtenden Indikatoren aus Anhang 1 der Verordnung (EU) 2019/2088 zugrunde gelegt. Die PAIs werden im Anlageprozess bei nachhaltigen Investitionen, bei den Ausschlüssen, bei der Klima-Ausrichtung sowie bei der ESG-Integration und direkt über die Berechnung eines PAI-Scores berücksichtigt. Das Asset Management bezieht Daten von Drittanbietern. Wo dies nicht möglich ist, wird er ihm zumutbare Anstrengungen unternehmen, um die benötigten Daten direkt zu erhalten oder eine bestmögliche Schätzung vorzunehmen. Die Informationen bzgl. der PAIs aus Artikel 11(2) der Verordnung (EU) 2019/2088 werden im Jahresbericht veröffentlicht.

- Nein



### **Welche Anlagestrategie wird mit diesem Finanzprodukt verfolgt?**

Der Fonds investiert in Aktien, Obligationen und Geldmarktinstrumente. Zwischen 35% und 80% des Fondsvermögens können in variabel- und festverzinsliche Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie Liquidität investiert werden. Der Aktienanteil liegt dabei zwischen 20% und 65%. Die Anlagerendite soll in EUR erwirtschaftet werden.

- **Worin bestehen die verbindlichen Elemente der Anlagestrategie, die für die Auswahl der Investitionen zur Erfüllung der beworbenen ökologischen oder sozialen Ziele verwendet werden?**

Das Asset Management berücksichtigt die vom jeweiligen Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale in der täglichen Verwaltung des Portfolios. Die Umsetzung der ansatzspezifischen Grenzen wird vom Asset Management in der Portfoliokonstruktion bei der Anlageentscheidung berücksichtigt und deren kontinuierliche Einhaltung im Rahmen der fortlaufenden Portfolioüberwachung sichergestellt.

#### **1. Ausschlüsse**

Die Berücksichtigung von Nachhaltigkeitsaspekten beinhaltet die Festlegung von Ausschlusskriterien aufgrund vom Asset Management als besonders kritisch beurteilten Geschäftsaktivitäten (siehe oben). Die Ausschlusskriterien werden zumindest jährlich auf neue Gegebenheiten und Erkenntnisse geprüft und gegebenenfalls angepasst.

#### **2. ESG-Integration**

Das Asset Management verfolgt im Anlageprozess einen sogenannten "ESG-Integrations-Ansatz" mit den ESG-Teilaspekten Umwelt, Soziales und Governance. Das bedeutet, dass er bei der Auswahl von Anlagen – ergänzend zur traditionellen Finanzanalyse – ökologische und/oder soziale Merkmale systematisch berücksichtigt, um

Die **Anlagestrategie** dient als Richtschnur für Investitionsentscheidungen, wobei bestimmte Kriterien wie beispielsweise Investitionsziele oder Risikotoleranz berücksichtigt werden.

einen positiven Beitrag zu den ESG Kriterien und gegebenenfalls der Rendite der Anlagen zu gewährleisten. Zu diesem Zweck werden Investitionen in sogenannte ESG Laggards limitiert. ESG Laggards sind Unternehmen innerhalb einer Branche oder eines spezifischen Industriezweigs, die im Vergleich auf Basis des proprietären ESG Scores besonders schlecht abschneiden. Wenn mit einem ESG-Laggard ein Engagement zu ESG-Themen durchgeführt wird, wird dieses Unternehmen nicht zu den ESG-Laggards gezählt, solange das Engagement aktiv ist. Die Dauer des Engagements kann sich typischerweise über einen Zeitraum von 4 Jahren erstrecken. Der ESG Score wird zumindest jährlich auf neue Gegebenheiten und Erkenntnisse geprüft und gegebenenfalls angepasst.

Das Gewicht aller Positionen in ESG Laggards des Teilfonds ist tiefer bzw. gleich hoch wie das Gewicht aller Positionen in ESG Laggards der Benchmark des Teilfonds.

### **3. Klima-Ausrichtung**

Das Asset Management richtet die Anlagetätigkeit wie folgt auf eine kontinuierliche Reduktion der CO<sub>2</sub>e-Intensität der Anlagen aus:

Das Asset Management legt für den Teilfonds einen Richtwert für die jährliche durchschnittliche CO<sub>2</sub>e-Intensität des Vermögens des Teilfonds fest. Den jeweiligen Richtwert bestimmt das Asset Management jeweils auf Basis des Zielwerts für die globale Absenkung des CO<sub>2</sub>e-Ausstosses (jährlich mindestens 4%), welcher sich am Pariser Klimaabkommen vom 12. Dezember 2015 orientiert. Der Richtwert für die durchschnittliche CO<sub>2</sub>e-Intensität des Teilfondsvermögens wird berechnet, indem die CO<sub>2</sub>e-Intensität der im Referenzindex enthaltenen Anlagen per Ende 2019 jährlich um den Zielwert (4%) und um das globale Wirtschaftswachstum diskontiert wird. Das Asset Management verwendet für das Wirtschaftswachstum ein rollierendes arithmetisches Mittel des nominalen Wirtschaftswachstums der jeweils letzten drei Jahre.

### **4. Nachhaltige Investitionen**

Das Asset Management strebt mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen an, indem Investitionen in Titel getätigt werden, die gemäss proprietärem Modell einen Beitrag zu einem oder mehreren SDGs sowie gleichwertigen Nachhaltigkeitszielen leisten. Dieser Beitrag kann hinsichtlich Produkte und Dienstleistungen (anhand des Umsatzanteils), nachhaltiger Wirtschaftsweise oder nachhaltiger Wertschöpfungsketten von Unternehmen erzielt werden. Staaten qualifizieren sich durch ein überdurchschnittliches Nachhaltigkeitsrating. Bei zweckgebundenen Finanzierungen von Unternehmungen, Supranationals und Staaten wird geprüft, ob sich die dadurch beschafften finanziellen Mittel positiv auf eines oder mehrere der SDGs oder gleichwertigen Nachhaltigkeitszielen auswirken. Die so ermittelten Emittenten werden vollumfänglich zu den nachhaltigen Investitionen gezählt.

- **Um welchen Mindestsatz wird der Umfang, der vor der Anwendung dieser Anlagestrategie in Betracht gezogenen Investitionen reduziert?**

Eine Quantifizierung des Mindestsatzes der Veränderung des Umfangs der investierbaren Anlagen ist nicht möglich.

- **Wie werden die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Unternehmen, in die investiert wird, bewertet?**

Bei der Anlageanalyse wird eine gute Unternehmensführung berücksichtigt, indem die Einhaltung folgender globaler Normen überprüft wird: Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC), die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte (UNGP) und das Übereinkommen der Internationalen Arbeitsorganisation (ILO).

Bei Verstößen von Unternehmen, die ein Screening auf Basis von Daten eines externen Datenanbieters hervorbringt, sucht das Asset Management, falls dies als geeignet erachtet wird, im Rahmen eines Engagements den Dialog und fordert die Unternehmen dazu auf, ihr Verhalten zu ändern. Tritt innert angemessener Zeit keine Änderung des Verhaltens ein, werden bestehende Anlagen veräußert. Dies geschieht auch dann, wenn ein Dialog im Hinblick auf die Schwere des Verstosses als nicht geeignet angesehen wird.

Die **Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung** umfassen solide Managementstrukturen, die Beziehungen zu den Arbeitnehmern, die Vergütung von Mitarbeitern sowie die Einhaltung der Steuervorschriften.



## Welche Vermögensallokation ist für dieses Finanzprodukt geplant?

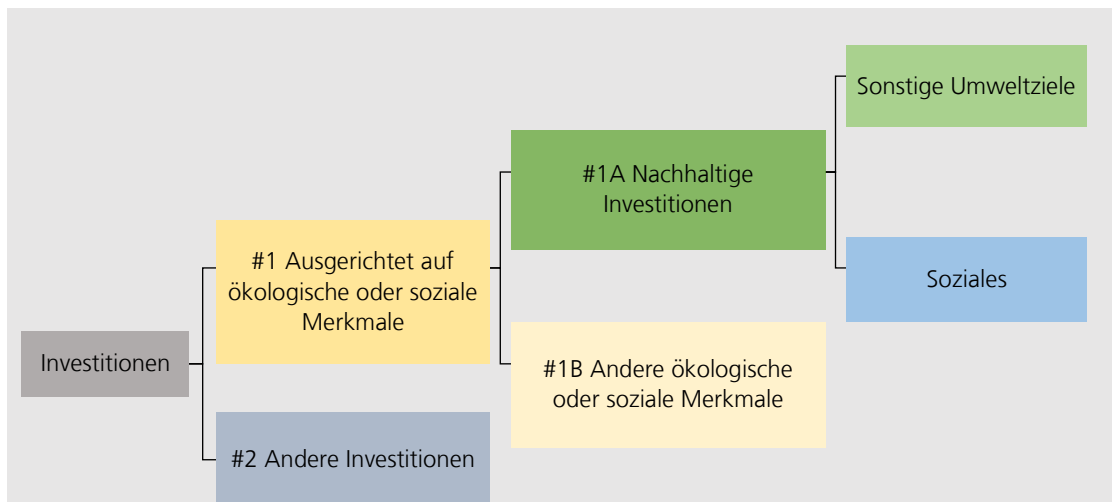
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Das Asset Management stellt sicher, dass mindestens 80% der Investitionen des Teilfonds die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale verfolgen (#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale), was mindestens 67% des Nettovermögens des Teilfonds entspricht.

Bis zu 20% der übrigen Investitionen können in Vermögenswerte erfolgen, die nicht mit den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen übereinstimmen („#2 Andere Investitionen“).

Damit behält sich das Asset Management im Umfang von höchstens 33% des Nettovermögens des Teilfonds vor, auch in andere Vermögenswerte zu investieren, die keine ökologischen und/oder sozialen Merkmale verfolgen, sowie Cash und Derivate (mit Ausnahme von Derivaten, denen Beteiligungs- oder Forderungstitel von einzelnen Unternehmungen zugrunde liegen, und ökologische und/oder soziale Merkmale verfolgen können) zu halten.

Es werden mindestens 20% der Investitionen des Teilfonds in "#1A Nachhaltige Investitionen" getätigt, welche wiederum in mindestens 10% "Sonstige Umweltziele" und mindestens 10% "Soziales" aufgeteilt werden. Die übrigen Investitionen, welche ökologische und/oder soziale Merkmale verfolgen (#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale), fallen unter "#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale".



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.

- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

- **Inwiefern werden durch den Einsatz von Derivaten, die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht?**

Derivate, denen Beteiligungs- oder Forderungstitel von einzelnen Unternehmungen zugrunde liegen, verfolgen ökologische und/oder soziale Merkmale. Alle anderen Derivate werden zu Absicherungszwecken und zur effizienten Umsetzung der Portfoliostrategie eingesetzt und verfolgen keine ökologischen und/oder sozialen Merkmale.



**In welchem Mindestmaß sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?**

0% der Investitionen. Der Fonds verfolgt keine nachhaltigen Investitionen im Einklang mit der EU-Taxonomie.

- **Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie<sup>1</sup> investiert?**

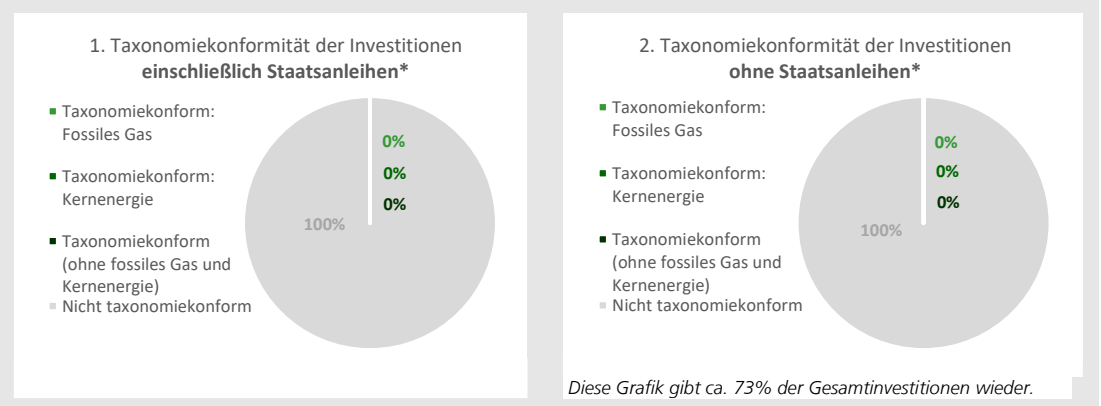
- Ja:
  - In fossiles Gas
  - In Kernenergie
- Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonmiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?**

0% der Investitionen.

<sup>1</sup>Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonmiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonmiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie **nicht berücksichtigen**.



**Wie hoch ist der Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?**

10% der Investitionen.



**Wie hoch ist der Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

10% der Investitionen.



**Welche Investitionen fallen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Bis zu 20% der Investitionen können in Vermögenswerte erfolgen, die nicht mit den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen übereinstimmen („#2 Andere Investitionen“).

Diese Vermögenswerte können alle in der spezifischen Anlagepolitik vorgesehenen Anlagen einschliesslich Zielfonds umfassen, und dienen dazu, die Anlagestrategie des Teilfonds zu verfolgen. In der Regel müssen bei diesen Investitionen die Grundsätze des ökologischen oder sozialen Mindestschutzes nicht umgesetzt werden.



**Wurde ein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist?**

Es wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist.



**Wo kann ich im Internet weitere produktspezifische Informationen finden?**

Weitergehende Informationen zur produktbezogenen Nachhaltigkeitspolitik sind auf folgender Website zum jeweiligen Teilfonds zu finden:

<https://products.swisscanto.com/products/product/LU0112804983>.