

ANHANG II

Vorlage – 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:

Unternehmenskennung (LEI-Code):

UBS (Lux) Fund Solutions – J.P. Morgan USD EM IG ESG Diversified Bond UCITS ETF 5493000JQHJLU284029

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.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt? [Bitte gegebenenfalls ankreuzen und ausfüllen; der Prozentsatz entspricht der Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen].

Ja

Nein

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

Es werden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt werden, enthält es einen Mindestanteil von 10% an nachhaltigen Investitionen.

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

mit einem Umweltziel 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

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

mit einem sozialen Ziel

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

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

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

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

Dieses Finanzprodukt wird passiv verwaltet und bildet einen Index nach («Index/Referenzwert»). Mit dem Finanzprodukt werden die folgenden Merkmale beworben:

- Nachbildung eines Referenzwerts, dessen Nachhaltigkeitsprofil (ESG-Bewertung) besser ist als beim Stammindex.

Der zur Erreichung des mit dem Finanzprodukt beworbenen Merkmals bestimmte Referenzwert ist der J.P. Morgan USD EM IG ESG Diversified Bond Index (Total Return).

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

Die Merkmale werden jeweils anhand der folgenden Indikatoren gemessen:

- ESG Quality Score des Fonds

- **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?**

Die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, bestehen darin, zu ökologischen und/oder sozialen Zielen beizutragen.

Das Finanzprodukt strebt nachhaltige Investitionen an und legt zu diesem Zweck mindestens 90% seines Nettovermögens in Wertpapieren an, die im Index enthalten sind. Der Index wendet eine Bewertungs- und Überprüfungsverfahren für Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) an mit dem Ziel, Emittenten mit einer höheren Rangposition bei den ESG-Kriterien zu bevorzugen und Emittenten mit einer niedrigeren Rangposition unterzugewichten oder auszuschließen.

Die ESG-Ratings von J.P. Morgan sollen Anlegern helfen, die Risiken und Chancen ihrer Investitionen in den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) zu erkennen und diese Faktoren in ihre Portfoliokonstruktion zu integrieren.

Der J.P. Morgan USD EM IG ESG Diversified Bond Index wendet J.P. Morgan ESG (JESG)-Emittentenbewertungen an, um den Marktwert der Indexbestandteile aus den jeweiligen Basisindizes anzupassen. Die JESG-Bewertungen der Emittenten sind eine 0-100-Perzentil-Rangliste, die auf der Grundlage der normalisierten ESG-Rohwerte der externen Research-Anbieter Sustainalytics und RepRisk berechnet wird. Der endgültige JESG-Score eines Emittenten umfasst einen gleitenden 3-Monats-Durchschnitt. Die JESG-Scores werden in fünf Bandbreiten eingeteilt, die zur Skalierung des Basisindexmarktwerts jeder Emission verwendet werden, wobei die Neugewichtung der Bandbreiten mit einer einmonatigen Verzögerung erfolgt.

Emittenten in der Bandbreite 5 werden aus dem Index ausgeschlossen, ebenso wie Unternehmensemittenten, die Einkünfte aus Tabak, Waffen, dem Abbau von Kraftwerkskohle oder der Kohleverstromung erzielen, sowie Unternehmensemittenten, die gegen die Grundsätze des UN Global Compact (UNGK) verstossen, und staatliche Emittenten, die gegen die Grundsätze von Freedom House verstossen. Wenn ein Instrument von der Climate Bonds Initiative als «grüne Anleihe» eingestuft wird, wird das Wertpapier ein Band hochgestuft. Grüne Anleihen von Emittenten, die bereits in Band 1 eingestuft sind, werden nicht weiter hochgestuft, während Anleihen in Band 5 weiterhin ausgeschlossen sind.

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.

	<ul style="list-style-type: none"> ● Inwiefern werden die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, keinem der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlageziele erheblich schaden?
	<p>Dieses Finanzprodukt wird aktiv verwaltet und bildet einen Index nach. Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren werden vom Indexanbieter berücksichtigt, soweit sie für die Indexfamilie geeignet sind.</p>
	<p><i>Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?</i></p>
	<p>Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren werden vom Indexanbieter berücksichtigt, soweit sie für die Indexfamilie geeignet sind</p> <p>Die Indizes umfassen den MSCI ESG Controversies Score, und Emittenten, die in erheblichem Masse gegen ESG-Normen verstossen, werden frühzeitig ausgeschlossen.</p> <p>Mittels MSCI ESG Controversies sollen ESG-bezogene Kontroversen, in die Emittenten involviert sind, frühzeitig und einheitlich bewertet werden. Emittenten mit einem «roten» MSCI ESG Controversies Score (Wert unter 1) werden aus den Nachhaltigkeitsindizes ausgeschlossen. Der Controversy Score misst, wie stark Emittenten an wesentlichen ESG-Kontroversen beteiligt sind und wie gut sie internationale Normen und Prinzipien einhalten.</p> <p>Das Finanzprodukt schliesst Anlagen in Unternehmen aus, die direkt an der Verwendung, Entwicklung, Herstellung, Lagerung, dem Transfer oder Handel von Streubomben und/oder Landminen, Atomwaffen, chemischen oder biologischen Waffen beteiligt sind.</p>
	<p><i>Wie stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?</i></p>
	<p>Das MSCI ESG Controversies-Tool überwacht die Beteiligung von Unternehmen an schwerwiegenden ESG-Kontroversen im Zusammenhang mit dem Geschäftsbetrieb und/oder den Produkten des Unternehmens, mögliche Verstösse gegen internationale Normen und Prinzipien wie die des Global Compact der Vereinten Nationen sowie sein Verhalten im Hinblick auf diese Normen und Prinzipien.</p>

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

Ja, dieses Finanzprodukt wird aktiv verwaltet und bildet einen Index nach. Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren werden vom Indexanbieter berücksichtigt, soweit sie für die Indexfamilie geeignet sind.

Der Index wendet J.P. Morgan ESG (JESG)-Emittentenbewertungen an, um den Marktwert der Indexbestandteile aus den jeweiligen Basisindizes anzupassen. Die JESG-Bewertungen der Emittenten sind eine 0-100-Perzentil-Rangliste, die auf der Grundlage der normalisierten ESG-Rohwerte der externen Research-Anbieter Sustainalytics und RepRisk berechnet wird. Der endgültige JESG-Score eines Emittenten umfasst einen gleitenden 3-Monats-Durchschnitt. Die JESG-Scores werden in fünf Bandbreiten eingeteilt, die zur Skalierung des Basisindexmarktwerts jeder Emission verwendet werden, wobei die Neugewichtung der Bandbreiten mit einer einmonatigen Verzögerung erfolgt.

Emittenten in der Bandbreite 5 werden aus dem Index ausgeschlossen, ebenso wie Unternehmensemittenten, die Einkünfte aus Tabak, Waffen, dem Abbau von Kraftwerkskohle oder der Kohleverstromung erzielen, sowie Unternehmensemittenten, die gegen die Grundsätze des UN Global Compact (UNGC) verstossen, und staatliche Emittenten, die gegen die Grundsätze von Freedom House verstossen. Wenn ein Instrument von der Climate Bonds Initiative als «grüne Anleihe» eingestuft wird, wird das Wertpapier ein Band hochgestuft. Grüne Anleihen von Emittenten, die bereits in Band 1 eingestuft sind, werden nicht weiter hochgestuft, während Anleihen in Band 5 weiterhin ausgeschlossen sind.

Nein



Welche Anlagestrategie wird mit diesem Finanzprodukt verfolgt?

Dieses Finanzprodukt zielt darauf ab, das/die in diesem Anhang genannte(n) Merkmal(e) mittels Indexauswahl und passiver Anlageverwaltung zu erreichen.

Dieses Finanzprodukt wird passiv verwaltet und ist bestrebt, die Wertentwicklung und das ESG-Profil des Index nachzubilden. Nachhaltigkeitsmerkmale und -risiken werden beim Auswahlprozess des Index berücksichtigt. Der Index, der nach Angaben des Indexanbieters nach Umwelt-, Sozial- oder Unternehmensführungskriterien geprüft wurde, und jede vom Indexanbieter angewandte Methode zur Bewertung von Nachhaltigkeitsmerkmalen und -risiken der Indexkomponenten können auf der Website des Indexanbieters eingesehen 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 folgende verbindliche Element / Die folgenden verbindlichen Elemente der Anlagestrategie wird/werden für die Auswahl der Investitionen zur Erreichung der mit diesem Finanzprodukt beworbenen Merkmale verwendet:


Merkmal 1):

- Besseres Nachhaltigkeitsprofil (d. h. höherer MSCI ESG Score) als der Stammindex.

Barmittel, Derivate und Anlageinstrumente ohne Rating werden nicht in die Berechnung einbezogen.

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

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

	<p>Das verbindliche Element wird / Die verbindlichen Elemente werden zum Quartalsende anhand des Durchschnitts aus den Werten aller Geschäftstage im Quartal ermittelt.</p>
	<ul style="list-style-type: none"> • Um welchen Mindestsatz wird der Umfang der vor der Anwendung dieser Anlagestrategie in Betracht gezogenen Investitionen reduziert?
	<p>Dieses Finanzprodukt legt mindestens 90% seines Gesamtnettovermögens in Wertpapieren an, die im Index enthalten sind, und der Indexanbieter wendet auf alle im Index vertretenen Wertpapiere ESG-Ratings an. Der Index schliesst gegenüber dem Anlageuniversum des Standardindex mindestens 20% der am schlechtesten bewerteten Wertpapiere aus. Somit ist davon auszugehen, dass das daraus resultierende ESG-Rating dieses Finanzprodukts höher ausfällt als das ESG-Rating eines Finanzprodukts, das einen Standardindex nachbildet.</p> <p>Aufgrund des geschichteten Sampling-Ansatzes (da eine vollständige Replikation dieses Rentenfonds nicht praktikabel ist) kann es vorübergehend zu leichten Abweichungen vom Index kommen, wobei das Gesamtziel des Fonds mit dem Index übereinstimmt.</p>
	<ul style="list-style-type: none"> • Wie werden die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Unternehmen, in die investiert wird, bewertet?
	<p>Die Bewertung der Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Unternehmen, in die investiert wird, erfolgt durch den Indexanbieter.</p> <p>Die Analyse der MSCI ESG-Ratings beginnt mit der Bewertung der Unternehmensführung des Unternehmens unter Berücksichtigung der Eigentümerschafts- und Kontrollstrukturen des Unternehmens, der Zusammensetzung und Effektivität seines Verwaltungsrats, der Wirksamkeit seiner Anreizpraktiken und seiner Integrität bezüglich der Rechnungslegung. Ausserdem wird das Geschäftsgebaren überwacht, einschliesslich etwaiger Kontroversen, die sich stark negativ auf den Wert des Unternehmens auswirken könnten.</p>
	<p>Welche Vermögensallokation ist für dieses Finanzprodukt geplant?</p> <p>Der Mindestanteil an Investitionen, die zur Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale getätigt werden, liegt bei 90 %. Der Mindestanteil der nachhaltigen Investitionen beträgt 10%.</p>

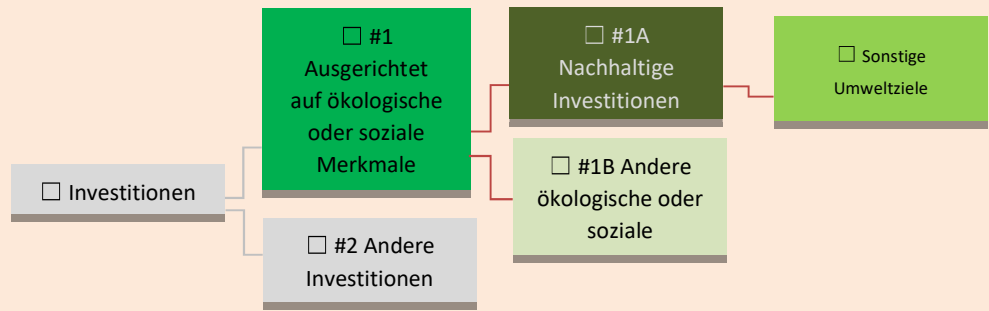
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



#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 werden nicht zur Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen Merkmale genutzt. Der Einsatz von Derivaten erfolgt in erster Linie zu Absicherungs- und Liquiditätsmanagementzwecken.



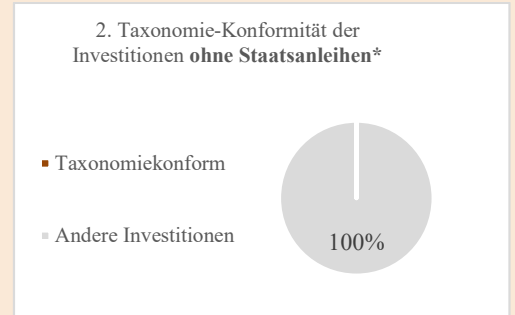
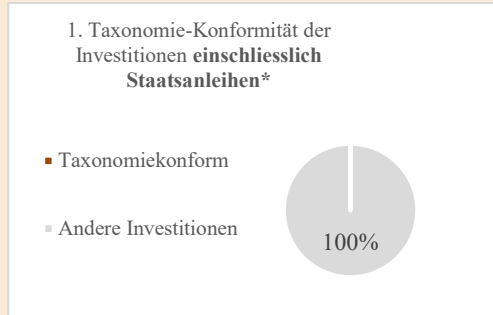
In welchem Mindestmass sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht anwendbar, da nur wenige ausreichend verlässliche Daten zur Ausrichtung an der EU-Taxonomie vorliegen und die Datenabdeckung derzeit noch zu gering ist, um eine sinnvolle Festlegung bezüglich eines Mindestanteils an taxonomiekonformen Investitionen für dieses Finanzprodukt vorzunehmen. Die Offenlegung und Berichterstattung zur Taxonomiekonformität werden ausgebaut, je mehr Daten mit zunehmender Entwicklung des EU-Regulierungsrahmens von den Unternehmen bereitgestellt werden. Dementsprechend liegt der Mindestanteil der zugrunde liegenden Anlagen dieses Finanzprodukts an nachhaltigen Investitionen mit einem an der Taxonomie-Verordnung ausgerichteten Umweltziel bei 0 %.


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 CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff «Staatsanleihen» alle Risikopositionen gegenüber Staaten.


 sind ökologisch nachhaltige Investitionen, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäss der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.

	<ul style="list-style-type: none"> Wie hoch ist der Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?
	Nicht anwendbar.
	Wie hoch ist der Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?
	Das Finanzprodukt investiert in Wirtschaftstätigkeiten, die zwar ökologisch nachhaltig, aber nicht mit der EU-Taxonomie konform sind. Grund hierfür sind die fehlenden notwendigen Durchführungsvorschriften und insbesondere die mangelnde Bereitstellung der erforderlichen taxonomielevanten Daten durch die Unternehmen, in die investiert wird, sowie das Fehlen einer klar definierten Berechnungsmethode. Mit dem Finanzprodukt wird ein Mindestanteil nachhaltiger Investitionen angestrebt, wie im Abschnitt über die Vermögensallokation in diesem Anhang dargelegt. Diese Investitionen verfolgen ein Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind.
	Wie hoch ist der Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen?
	Nicht anwendbar.
	Welche Investitionen fallen unter «#2 Andere Investitionen», welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?
	Unter «#2 Andere Investitionen» fallen Barmittel und unbewertete Instrumente, die zu Liquiditätszwecken und zur Steuerung des Portfoliorisikos in Bezug auf die Gewichtung der

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Investitionsziel des Finanzprodukts erreicht wird.



	Benchmark gehalten werden. In diese Kategorie können auch Wertpapiere fallen, zu denen keine einschlägigen Daten vorliegen.
	Wurde ein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist?
	Der zur Erreichung des mit dem Finanzprodukt beworbenen Merkmals bestimmte Referenzwert ist der J.P. Morgan USD EM IG ESG Diversified Bond Index (Total Return).
	<ul style="list-style-type: none"> • Inwiefern ist der Referenzwert kontinuierlich auf die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet?
	Der Referenzwert des Finanzprodukts wurde zunächst aufgrund seiner Relevanz für die Anlagestrategie und die Erreichung der beworbenen Merkmale ausgewählt. Eine Neuausrichtung des Index erfolgt monatlich. Weitere Einzelheiten über die vom Indexanbieter angewandte Indexmethode sind nachstehend dargelegt.
	<ul style="list-style-type: none"> • Wie wird die kontinuierliche Ausrichtung der Anlagestrategie auf die Indexmethode sichergestellt?
	<p>Die Ausrichtung der Anlagestrategie auf die Indexmethode wird kontinuierlich sichergestellt, da der Indexanbieter den Index regelmässig neu gewichtet und der Anlageverwalter den Index unter Einhaltung der in der Anlagepolitik des Fonds vorgesehenen Grenzen nachbildet.</p> <p>Der Referenzwert des Finanzprodukts wurde zunächst aufgrund seiner Relevanz für die Anlagestrategie und die Erreichung der beworbenen Merkmale ausgewählt.</p> <p>Die Anlagestrategie des Fonds besteht darin, die Rendite der Benchmark und ihre Merkmale, einschliesslich der ESG-Merkmale, so genau wie möglich und soweit sinnvoll nachzubilden. Die Anlagestrategie besteht darin, den Index unter Anwendung eines geschichteten Ansatzes («Stratified Sampling») nachzubilden und den Tracking Error zu kontrollieren.</p> <p>Der Anlageverwalter prüft bei der Produktgestaltung die Indexmethode und kann sich an den Indexanbieter wenden, wenn die Indexmethode nicht mehr mit der Anlagestrategie des Finanzprodukts im Einklang steht.</p>
	<ul style="list-style-type: none"> • Wie unterscheidet sich der bestimmte Index von einem relevanten breiten Marktindex?
	<p>Der Stammindex, der J.P. Morgan USD EM IG ESG Diversified Bond Index (Total Return) bildet Instrumente ab, die in den etablierten Indizes J.P. Morgan EMBI Global Diversified und J.P. Morgan CEMBI Broad Diversified in der Kategorie Investment Grade (IG) eingestuft sind, und kombiniert sie mit einer Gewichtung nach der Marktkapitalisierung.</p> <p>Der J.P. Morgan USD EM IG ESG Diversified Bond Index wendet ausserdem J.P. Morgan ESG (JESG)-Emittentenbewertungen an, um den Marktwert der Indexbestandteile aus den jeweiligen Basisindizes anzupassen. Die JESG-Bewertungen der Emittenten sind eine 0-100-Perzentil-Rangliste, die auf der Grundlage der normalisierten ESG-Rohwerte der externen Research-Anbieter Sustainalytics und RepRisk berechnet wird. Der endgültige JESG-Score eines Emittenten umfasst einen gleitenden 3-Monats-Durchschnitt. Die JESG-Scores werden in fünf Bandbreiten eingeteilt, die zur Skalierung des</p>

	<p>Basisindexmarktwerts jeder Emission verwendet werden, wobei die Neugewichtung der Bandbreiten mit einer einmonatigen Verzögerung erfolgt.</p> <p>Emittenten in der Bandbreite 5 werden aus dem Index ausgeschlossen, ebenso wie Unternehmensemittenten, die Einkünfte aus Tabak, Waffen, dem Abbau von Kraftwerkskohle oder der Kohleverstromung erzielen, sowie Unternehmensemittenten, die gegen die Grundsätze des UN Global Compact (UNGC) verstossen, und staatliche Emittenten, die gegen die Grundsätze von Freedom House verstossen. Wenn ein Instrument von der Climate Bonds Initiative als «grüne Anleihe» eingestuft wird, wird das Wertpapier ein Band hochgestuft. Grüne Anleihen von Emittenten, die bereits in Band 1 eingestuft sind, werden nicht weiter hochgestuft, während Anleihen in Band 5 weiterhin ausgeschlossen sind.</p>
	<ul style="list-style-type: none"> • Wo kann die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes eingesehen werden?
	<p>Die Methode des Indexaufbaus ist im Produktblatt des Fonds im Prospekt angegeben.</p>
	<p>Wo kann ich im Internet weitere produktspezifische Informationen finden?</p> <p>Weitere produktspezifische Informationen sind abrufbar unter:</p>
	<p>www.ubs.com/etf</p>