

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) Bond Fund Responsible Global Rates

Unternehmenskennung (LEI-Code):

222100LOO8ZT8UVERA95

Version:

November 2024

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 _____% 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 Ausschlusskriterien, die im Anlageprozess angewandte ESG-Integration sowie die Ausrichtung auf die Reduktion der CO₂e-Intensität.

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

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

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. Ausschlusskriterien

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 (SVVK-ASIR)
- 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 SVVK-ASIR 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.

- * Nur bei einer Weiterverbreitung, die gegen den Vertrag über die Nichtverbreitung von Kernwaffen (Non-Proliferation Treaty: «NPT») verstösst.
- ** 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 Sustainable Bonds müssen nicht ausgeschlossen werden. Bei einem Green Bond und bei einem Sustainable Bond muss der Emittent die durch die Emission des Green bzw. Sustainable 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. Sustainable 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. Anlagen in Green Bonds oder Sustainable Bonds leisten damit einen Beitrag zu einer positiven Veränderung in Bezug auf das jeweilige Ausschlusskriterium.

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 Asset Management 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. Reduktion der CO₂e-Intensität

Das Asset Management richtet die Anlagetätigkeit darüber hinaus auf eine relative Reduktion der CO₂e-Intensität der Anlagen aus.

Die CO₂e-Intensitäten sind bei Unternehmungen definiert als CO₂e-Ausstoss im Verhältnis zum Umsatz (Tonnen CO₂e pro Million US-Dollar Umsatz) und bei Staatspapieren als CO₂e-Ausstoss im Verhältnis zur volkswirtschaftlichen Wertschöpfung (Tonnen CO₂e pro Million US-Dollar Bruttoinlandsprodukt). Es werden Treibhausgase mit Erderwärmungswirkung nach Massgabe des internationalen Standards "Greenhouse Gas Protocol" (GHG-Protokoll) miteinbezogen (gemessen in CO₂-Äquivalenten; CO₂e). Für die Bestimmung der CO₂e-Intensitäten werden Daten von unabhängigen Dritten verwendet. Gestützt auf diese Daten berechnet das Asset Management die massgeblichen CO₂e-Intensitäten, die der Datenverfügbarkeit und Datenqualität allfälligen methodologischen Diskrepanzen und Spezialfällen Rechnung tragen.

Anlagen, die den unter Ziffern 1-2 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 CO₂e-Intensitäten an.

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?**

Mit diesem Finanzprodukt werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

Mit diesem Finanzprodukt werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht relevant für dieses Finanzprodukt, da es keine nachhaltigen Investitionen tätigt.

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:

Nicht relevant für dieses Finanzprodukt, da es keine nachhaltigen Investitionen tätigt.

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.

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 Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 zugrunde gelegt. Die PAIs werden im Anlageprozess bei den Ausschlusskriterien, bei der Reduktion der CO₂e-Intensität 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 es 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 weltweit mindestens 51 % seines Vermögens in Obligationen, Notes, sowie andere fest- oder variabelverzinsliche Forderungswertpapiere und -rechte von öffentlich-rechtlichen Emittenten. Zudem kann der Teilfonds in Anleihen aus dem chinesischen Festland investieren, welche an Interbanken-Anleihemärkten in China gehandelt 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. Ausschlusskriterien

Die Berücksichtigung von Nachhaltigkeitsaspekten beinhaltet die Festlegung von Ausschlusskriterien aufgrund vom Asset Management als besonders kritisch beurteilten Geschäftsaktivitäten (s. 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

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

bedeutet, dass es bei der Auswahl von Anlagen – ergänzend zur traditionellen Finanzanalyse – ökologische und/oder soziale Merkmale systematisch berücksichtigt, um 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. Der ESG Score wird zumindest jährlich auf neue Gegebenheiten und Erkenntnisse geprüft und gegebenenfalls angepasst. Der gewichtete proprietäre ESG-Score für diesen Teilfonds liegt über 66. Der ermittelte ESG-Score bemisst sich auf einer Skala von 0 bis 100, wobei 0 der tiefste und 100 der beste Wert darstellt.

3. Reduktion der CO₂e-Intensität

Das Asset Management richtet die Anlagetätigkeit wie folgt auf eine relative Reduktion der CO₂e-Intensität der Anlagen aus: Der Teilfonds weist eine tiefere CO₂e Intensität gegenüber dem Benchmark (Bloomberg Global Treasury TR Index Unhedged) aus.

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

Der Fonds verfolgt eine aktive Anlagestrategie ohne Referenzuniversum. 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). Jeder Verstoß gegen diese Normen führt zum Ausschluss des Emittenten aus dem investierbaren Universum des Finanzproduktes.

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.

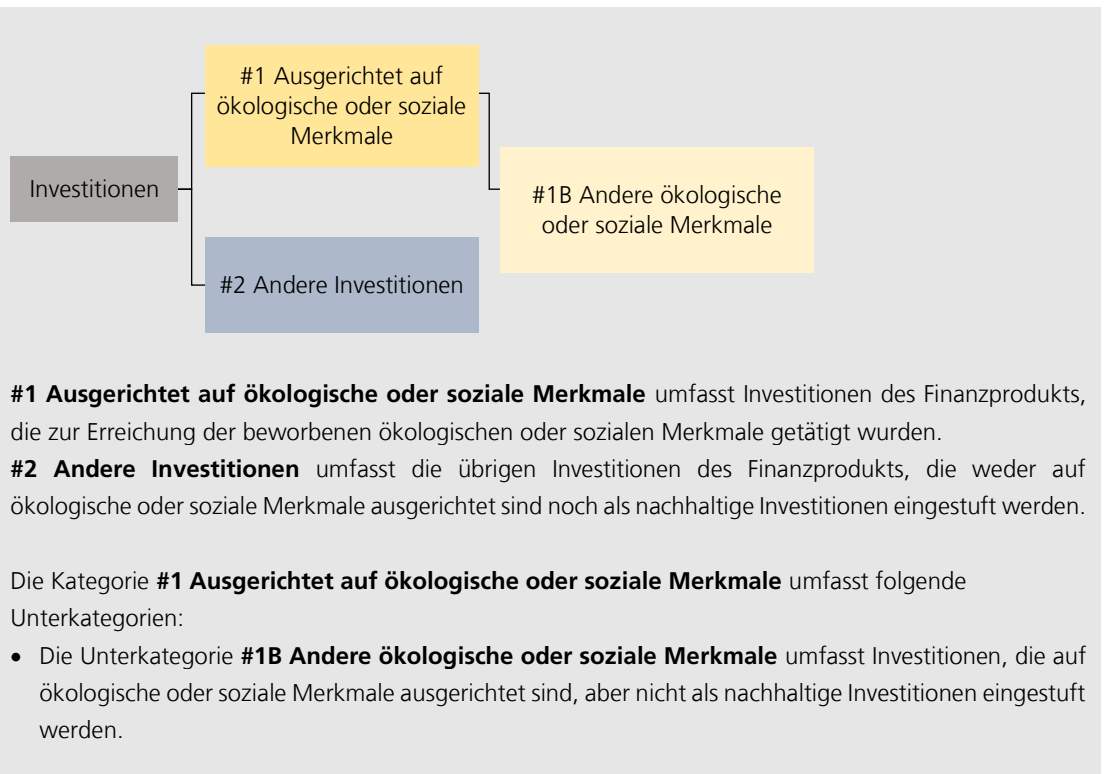
Die **Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung** umfassen solide Managementstrukturen, die Beziehungen zu den Arbeitnehmern, die Vergütung von Mitarbeitern sowie die Einhaltung der Steuervorschriften.



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 67% des Nettovermögens des Teilfonds entsprechend der Darstellung unten die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale verfolgen (#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale). Davon fallen alle Investitionen unter #1B Andere ökologische oder soziale Merkmale. Das Asset Management behält sich im Umfang von höchstens 33% des Nettovermögens des Teilfonds vor, auch in andere Vermögenswerte (#2 Andere Investitionen) zu investieren, die keine ökologischen und/oder sozialen Merkmale verfolgen.



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

Derivate werden nur in geringem Umfang zu Absicherungszwecken eingesetzt und verfolgen keine ökologischen und/oder sozialen Merkmale.



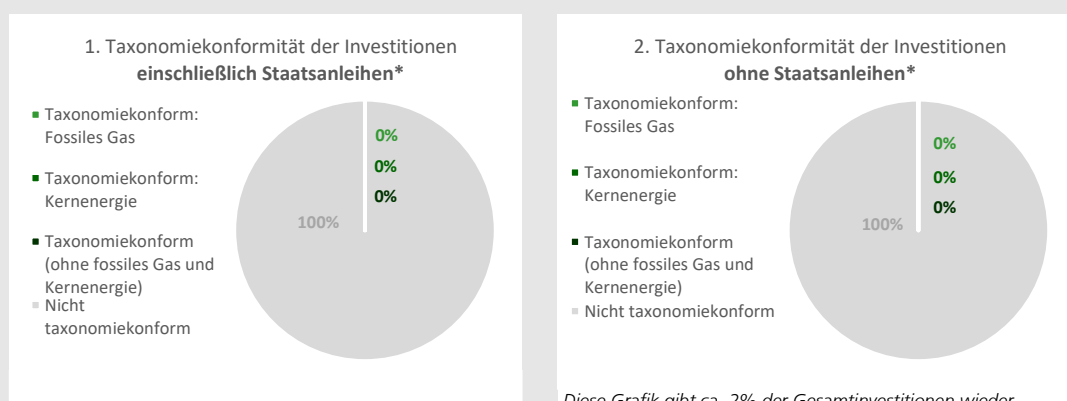
In welchem Mindestmaß sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

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

● Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen 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 Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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

0% des Portfolios.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-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 CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, 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-taxonomiekonforme 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?

0% des Portfolios.



Wie hoch ist der Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

0% des Portfolios.



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

Dieser Teilfonds kann bis zu 33% des Nettofondsvermögens in Vermögenswerte investieren, die nicht mit den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen übereinstimmen (#2 Andere Investitionen). Diese Vermögenswerte können alle in der spezifischen Anlagepolitik vorgesehenen Anlagen umfassen, einschliesslich Derivate zu Absicherungszwecken und flüssige Mittel, und dienen dazu, die Anlagestrategie des Teilfonds zu verfolgen. In der Regel müssen bei diesen Anlagen 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/LU2658244392>.