



Regelmässige Information zum 31.03.2024

Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8, Absätze 1, 2, 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 Responsible Focus (CHF)

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300WLCBSRIB0E4R71

Benchmark

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF) in CHF

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

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja | | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein | |
|--|--|---|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _ % | <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 36.41% an nachhaltigen Investitionen | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _ % | | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt . | |



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die von dem Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wurden durch folgende Aktivitäten erreicht:

1. Ausschlusskriterien
2. ESG-Integration
3. Reduktion der CO₂e-Intensität
4. Nachhaltige Investitionen





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

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Aus Übersichtsgründen werden die Angaben zur Performance (siehe Details am Ende des Reports) der Nachhaltigkeitsindikatoren direkt mit dem historischen Vergleich in der nächsten Frage beantwortet.

...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Ausschlusskriterien

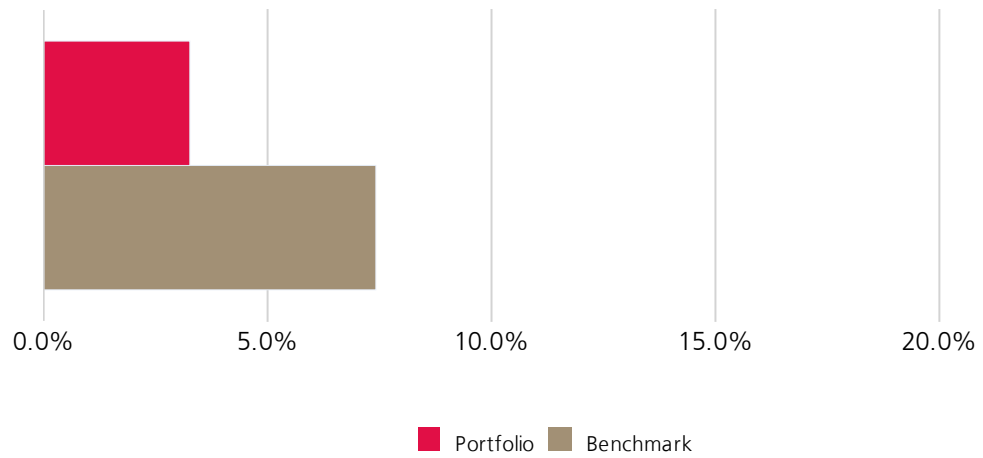
| Responsible | | | | | | | |
|--|-------------------|--|------------------------------|--|-------------------|-------------------|------------------------------|
| Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark | Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark |
|  Kohlereserven (ex. Metalproduktion) | 0.00% | 0.76% | 55 |  Herstellung von Kriegstechnik (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.74% | 31 |
| Förderung von Kohle (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.25% | 28 | Herstellung von Waffen & Munition | 0.00% | 0.43% | 11 |
|  Klimawandel | |  Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit | | Kontroverse Waffen | 0.00% | 0.38% | 5 |
| | | | | UN Global Compact Verstöße | 0.00% | 0.35% | 21 |
| | | | | Ausbeuterische Kinderarbeit | 0.00% | 0.28% | 6 |
| | | | | Herstellung von Pornografie | 0.00% | 0.02% | 2 |

Zwecks Minderung der Nachhaltigkeitsrisiken und mit dem Ziel, nicht in Wertpapiere der oben aufgeführten kontroversen Geschäftsmodelle zu investieren, sind die oben genannten Ausschlusskriterien angewendet worden. Die Tabelle zeigt die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien verstossen haben, sowie die jeweilige Portfolio- und Benchmark-Exposition. Liegen bei einem Unternehmen mehrere Verstöße vor, werden diese für jedes Kriterium separat aufgeführt. Daher ist die Summe aller Positionen in diesem Bericht in der Regel höher als die effektive Allokation zu den oben abgebildeten Kriterien. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht. Aus Übersichtsgründen werden die Ausschlusskriterien aggregiert.

| | Indikator | Berichtsjahr 2023 | Berichtsjahr 2024 |
|-----------|----------------------------|-------------------|-------------------|
| Portfolio | Ausschlusskriterien Total* | 0% | 0% |
| Benchmark | Ausschlusskriterien Total* | 2.16% | 2.42% |

*alle Ausschlusskriterien kumuliert.

ESG-Integration

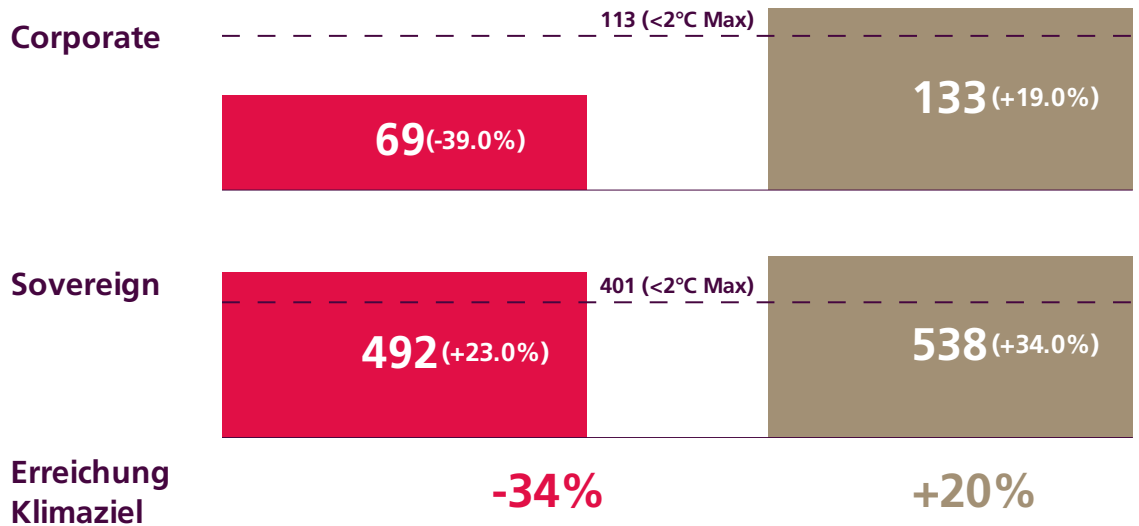


Das Portfolio strebte in der Berichtsperiode im Vergleich zur Benchmark eine geringere Exposition zu ESG-Laggards an. ESG-Laggards sind Unternehmungen mit der schwächsten Umwelt-, Sozial und Governance-Performance des relevanten Anlageuniversums.

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Berichtsjahr 2023 | Berichtsjahr 2024 |
|-----------|----------------------------|-------------------|-------------------|
| Portfolio | Exposition zu ESG Laggards | 4.87% | 3.26% |
| Benchmark | Exposition zu ESG Laggards | 9.46% | 7.42% |

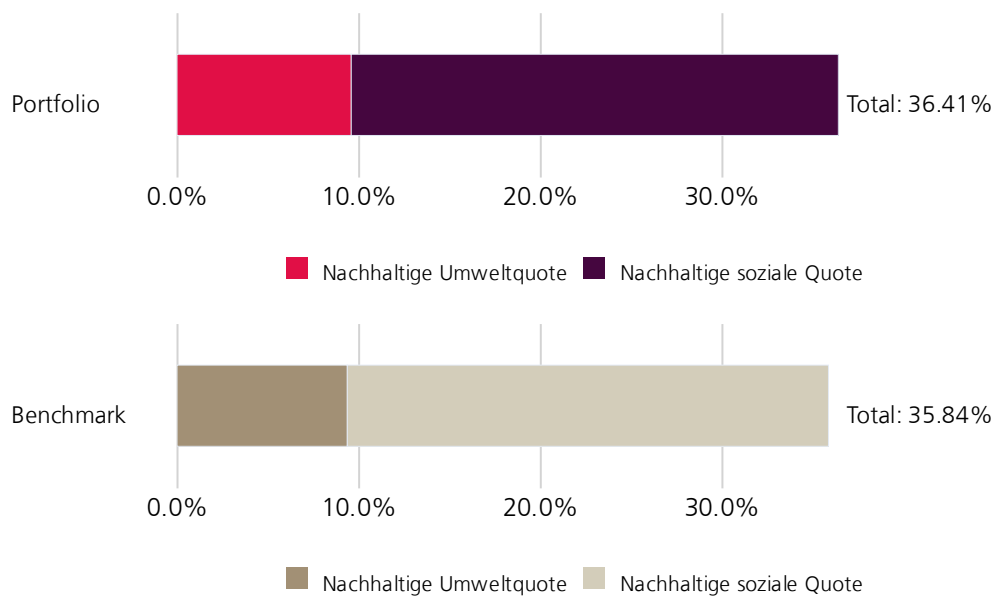
Reduktion der CO₂e-Intensität



Im Einklang mit dem < 2° Pariser Klimaziel ("<2°C Max") zielte die Investitionstätigkeit des Fonds während der Berichtsperiode darauf ab, die CO₂e-Emissionen des Portfolios, um mindestens 4 % pro Jahr zu reduzieren. Der Absenkpfad berechnet sich aus den gewichteten CO₂e-Intensitäten der Benchmark, diskontiert mit 4 % pro Jahr zuzüglich des realen Wirtschaftswachstums. Die gestrichelten 2° Max-Linie zeigt den Maximalwert an. Die Balken stellen die CO₂e-Intensitäten des Portfolios und der Benchmark dar. CO₂e-Intensitäten unterhalb der 2° Max-Linie zeigen an, dass das Portfolio oder die Benchmark das <2°-Klimaziel erfüllen. Werte bei "Erreichung Klimaziel" setzen das Portfolio und die Benchmark in Relation zum Klimaziel. Negative Werte bedeuten, dass das Ziel erreicht wurde. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Berichtsjahr 2023 | Berichtsjahr 2024 |
|-----------|--|-------------------|-------------------|
| Portfolio | CO ₂ e-Intensität Corporate | 80 | 69 |
| | CO ₂ e-Intensität Sovereign | 583 | 492 |
| | Erreichung Klimaziel | -32% | -34% |
| | Reduktion Corporate | -34% | -39% |
| Benchmark | Reduktion Sovereign | 36% | 23% |
| | CO ₂ e-Intensität Corporate | 156 | 133 |
| | CO ₂ e-Intensität Sovereign | 581 | 538 |
| | Erreichung Klimaziel | 27% | 20% |
| | Reduktion Corporate | 27% | 19% |
| | Reduktion Sovereign | 36% | 34% |

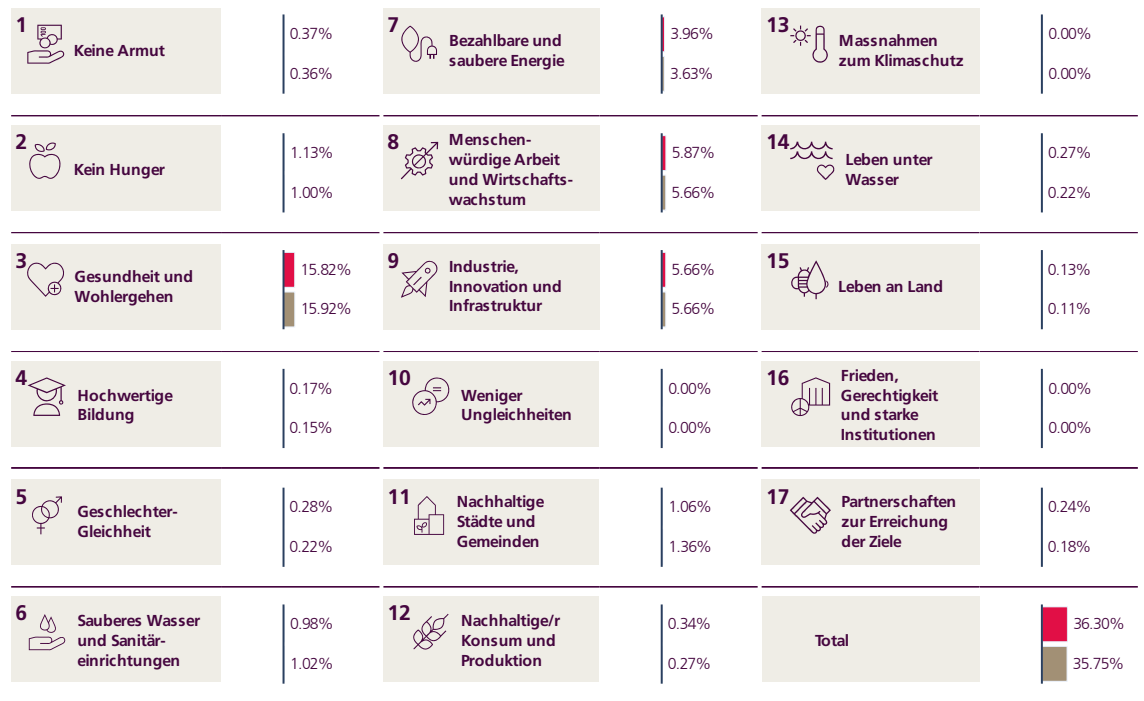
Nachhaltige Investitionen



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den UN Sustainable Development Goals (SDGs) ergebenden Umwelt- und sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind. Der Fonds hat keine Investitionen in ökologisch nachhaltige Aktivitäten im Sinne der EU Taxonomie-Verordnung angestrebt. Das Asset Management des Teilfonds hat eine Methodologie zur Definition nachhaltiger Investitionen entwickelt, die den Anforderungen des Art. 2 (17) SFDR entspricht. Die Methodologie ist detailliert in den Vorvertraglichen Informationen beschrieben. Die Aufteilung der nachhaltigen Investitionen in UN SDGs werden in folgender Grafik gemacht.

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Berichtsjahr 2023 | Berichtsjahr 2024 |
|-----------|---|-------------------|-------------------|
| Portfolio | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 8.68% | 9.64% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 26.27% | 26.76% |
| | Total nachhaltige Quote | 34.95% | 36.41% |
| Benchmark | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 8.34% | 9.36% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 26.68% | 26.49% |
| | Total nachhaltige Quote | 35.02% | 35.84% |



■ Portfolio
 ■ Benchmark

Aufgrund der unterschiedlichen Behandlung von Green, Social und Sustainable Bonds kann das SDG-Exposure von den prozentualen Umsätzen der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und den der Benchmark, welche im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind, abweichen.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Im Berichtszeitraum konzentrierte sich der Vermögensverwalter auf Wertpapiere von Unternehmen, welche Umsätze aus dem Verkauf von Produkten und Dienstleistungen mit einem positiven Beitrag zu den 17 SDGs erzielten und dabei keine DNSH- und/oder Minimum Safeguards-Verletzungen aufgewiesen haben.

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 getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Emittenten mit einem negativen Nettobeitrag zu den SDGs wurden in der Berichtsperiode aus dem Anlageuniversum des Finanzproduktes entfernt. Darüber hinaus berücksichtigte der Teilfonds nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (engl: Principal Adverse Impacts - PAI). Zu diesem Zweck wurden die obligatorischen Indikatoren Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 zugrunde gelegt. Unternehmen, die der Vermögensverwalter gemäss PAI als besonders schädlich einstufte, wurden entsprechend nicht zu den nachhaltigen Anlagen gezählt. Emittenten, welche die PAIs 7 (Biodiversität), 10 (Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC)/OECD Leitsätze für multinationale Unternehmen) oder 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) verletzen, haben einen PAI-Score von null erhalten. Aus den restlichen PAI-Indikatoren wurde ein PAI-Score berechnet. Instrumente von Emittenten mit einem Score < 10 wurden nicht den nachhaltigen Investitionen angerechnet.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die nachteiligen Auswirkungen (PAI) sind systematisch im Anlageprozess berücksichtigt worden.

● **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 wurden in der Berichtsperiode 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). Jeder schwerwiegende Verstoß gegen diese Normen führte zum Ausschluss des Emittenten aus dem investierbaren Universum des Finanzprodukts.

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 Unionskriterien 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.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

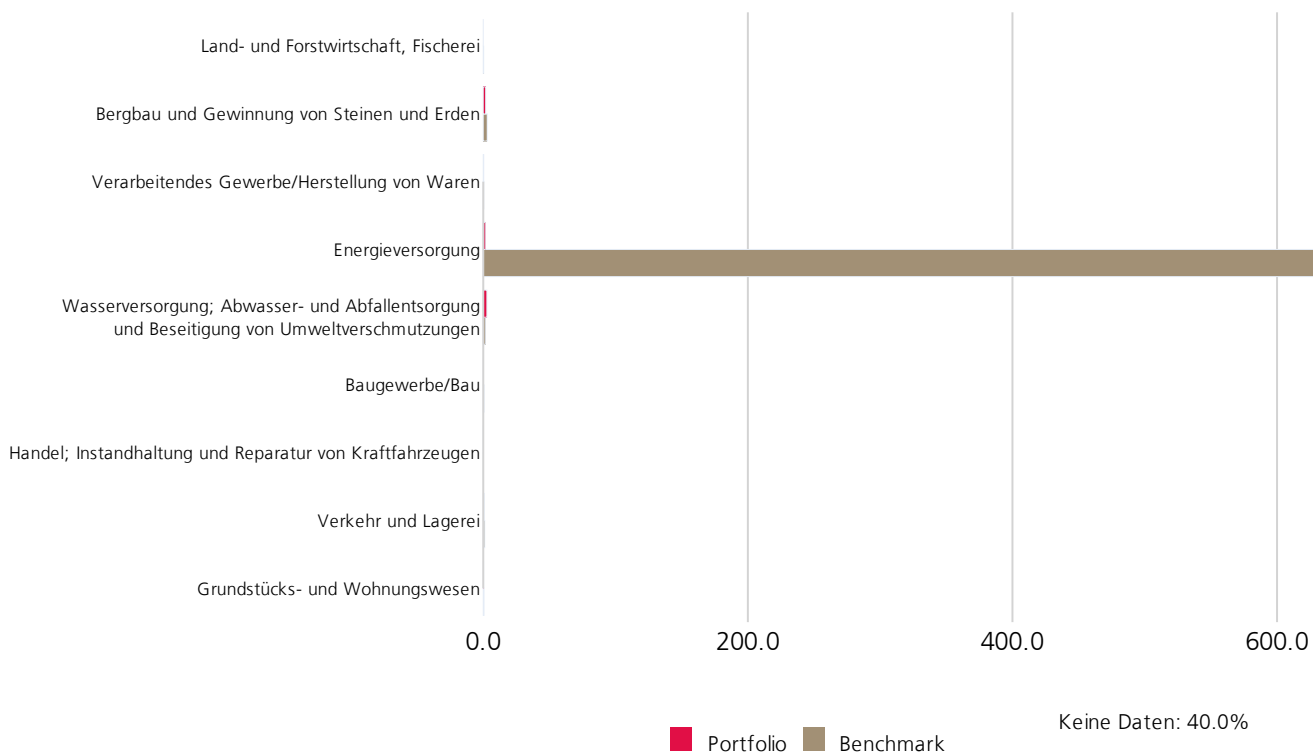
Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Corporate Anlagen

Primäre Indikatoren - Energie und Emissionen

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 1. THG-Emissionen | 1a. GHG Emissions - Scope 1 per Mio EUR Enterprise Value | 4905.13 | 84.23% | 3081.77 | 9138.93 | 6154.45 | |
| | 1b. GHG Emissions - Scope 2 per Mio EUR Enterprise Value | 1128.83 | 84.23% | 674.34 | 1586.1 | 1162.44 | |
| | 1c. GHG Emissions - Scope 3 per Mio EUR Enterprise Value | 61641.1 | 84.23% | 37311.6 | 62228.6 | 41757.7 | |
| 2. CO ₂ -Fussabdruck | 2. GHG Emissions - Scope 1+2+3 per Mio EUR Enterprise Value | 356.39 | 84.23% | 230.35 | 384.96 | 275.18 | |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird | 3. GHG Emissions - Emissions Intensity - Total Emissions (EUR) | 94.77 | 84.45% | 78.03 | 177.65 | 141.79 | |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind | 4. Fossil Fuel - Involvement (PAI) | 4.52% | 85.17% | 2.92% | 6.61% | 4.93% | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|---|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|---|
| 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen | 5a. CR Raw - Energy use - Coal/nuclear/unclear energy sources | 54.21% | 55.18% | 39.82% | 57.45% | 41.95% | |
| | 5b. Non-renewable energy consumption | 37.01% | 56.06% | 55.79% | 37.69% | 55.86% | Der Verbrauch nicht-erneuerbarer Energie umfasst den Verbrauch von Energie, die aus nicht-erneuerbaren Quellen erzeugt wird, sowie den Verbrauch von Energie aus Biomasse. Alle Zahlen zum Energieverbrauch, bei denen die Energiequelle unklar ist, sind ebenfalls in diesem Faktor enthalten. |
| | 5c. Non-renewable energy production | 0.85% | 83.02% | 0.42% | 1.83% | 1.44% | |
| 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren | 6. Energy consumption intensity (GWh/mEUR) | 0.3 | 61.42% | 0.24 | 10.63 | 3.91 | |

Intensität des Energieverbrauchs pro High Impact Sector (pro Mio. EUR) (PAI 6 siehe oben)



| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|---|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | 7. Companies negatively affecting biodiversity-sensitive areas | 0.06% | 85.19% | 0.07% | 0.05% | 0.03% | |
| 8. Emissionen in Wasser | 8. CR Raw - COD emissions | 179.63 | 9.49% | 129.64 | 204.92 | 163.03 | |
| 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | 9. CR Raw - Hazardous waste | 0.08 | 22.26% | 0 | 0.82 | 0 | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 10. UNGC / OECD Guidelines Violation | 0% | 85.19% | 0.04% | 0.35% | 0.15% | |
| 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen | 11. Lack of processes monitoring UNGC and OECD Guidelines compliance | 15.97% | 83.05% | 8.29% | 19.74% | 13.25% | |
| 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle | 12. Unadjusted gender pay gap | 0.2% | 5.86% | 0.18% | 0.32% | 0.32% | |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen | 13. Ratio of female to male board members | 53.23% | 82.84% | 39.19% | 51.34% | 37.48% | |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 14. Controversial weapons involvement (APM, CM, Bio, Chem) | 0% | 85.2% | 0% | 0.08% | 0.11% | |

Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Staatliche und Supranationale Vermögenswerte

Primäre Indikatoren

| Umwelt | | | | | | | |
|--------------------|-------------------|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 15. GHG Intensität | 15. GHG Intensity | 576.39 | 6.8% | 515.47 | 602.23 | 498.66 | |

| Sozial | | | | | | | |
|--|---|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen | 16a. Countries subject to social violations (#) | 18 | 3.04% | 13.25 | 34 | 27.75 | |
| | 16b. Countries subject to social violations (%) | 20.42% | 3.04% | 13.47% | 6.08% | 5.47% | |

| Indikator | Metrik |
|-----------|---|
| 1a | Scope-1-Treibhausgas-Emissionen |
| 1b | Scope-2-Treibhausgas-Emissionen |
| 1c | Scope-3-Treibhausgas-Emissionen |
| 2. | CO2-Fussabdruck pro Mio EUR |
| 3. | THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird |
| 4. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| 5a | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5b | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5c | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 6. | Energieverbrauch in GWh pro einer Million EUR Umsatz der Unternehmen, in die investiert wird, aufgeschlüsselt nach klimaintensiven Sektoren |
| 7. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, mit Standorten/Betrieben in oder in der Nähe von Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, sofern sich die Tätigkeiten dieser Unternehmen nachteilig auf diese Gebiete auswirken |
| 8. | Tonnen Emissionen in Wasser, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR verursacht werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 9. | Tonnen gefährlicher und radioaktiver Abfälle, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR erzeugt werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 10. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren |
| 11. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die keine Richtlinien zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder keine Verfahren zur Bearbeitung von Beschwerden wegen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen eingerichtet haben |
| 12. | Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle bei den Unternehmen, in die investiert wird |
| 13. | Durchschnittliches Verhältnis von Frauen zu Männern in den Leitungs- und Kontrollorganen der Unternehmen, in die investiert wird, ausgedrückt als Prozentsatz aller Mitglieder der Leitungs- und Kontrollorgane |
| 14. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind |
| 15. | THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird |
| 16a | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |
| 16b | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:
01.04.2023 - 31.03.2024

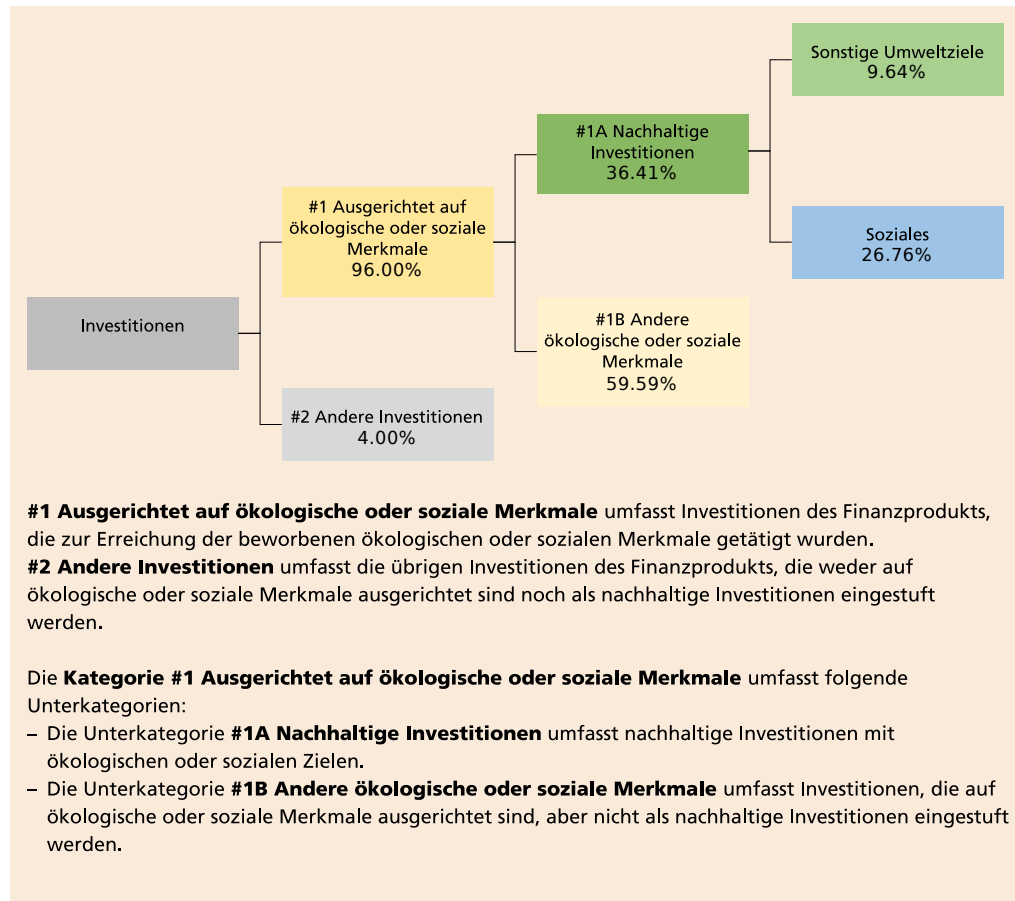
| Grösste Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|------------------------------------|-------------------------|-------------|
| Nestle S.A. | Manufacturing | 5.49% | Switzerland |
| Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets NT USD Klasse | | 4.45% | |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF NT Klasse | | 3.95% | |
| Roche Holding Ltd Dividend Right Cert. | Manufacturing | 3.79% | Switzerland |
| Novartis AG | Manufacturing | 3.42% | Switzerland |
| GAM Star Fund PLC - GAM Star Cat Bond Institutional Class CHF Accum.Ptg.Shs | Financial and Insurance Activities | 3.18% | Switzerland |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities NT USD Klasse | | 3.16% | |
| Swisscanto (LU) Equity Fund Systematic Responsible Japan NT CHF Klasse | | 2.71% | |
| Apple Inc. | Manufacturing | 2.06% | USA |
| Microsoft Corporation | Information and Communication | 2.02% | USA |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates NT USD Klasse | | 1.83% | |
| Zurich Insurance Group Ltd | Financial and Insurance Activities | 1.56% | Switzerland |
| Compagnie Financiere Richemont SA | Manufacturing | 1.49% | Switzerland |
| UBS Group AG | Financial and Insurance Activities | 1.39% | Switzerland |
| Swisscanto (LU) Equity Fund Systematic Responsible Emerging Markets NT CHF Klasse | | 1.26% | |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

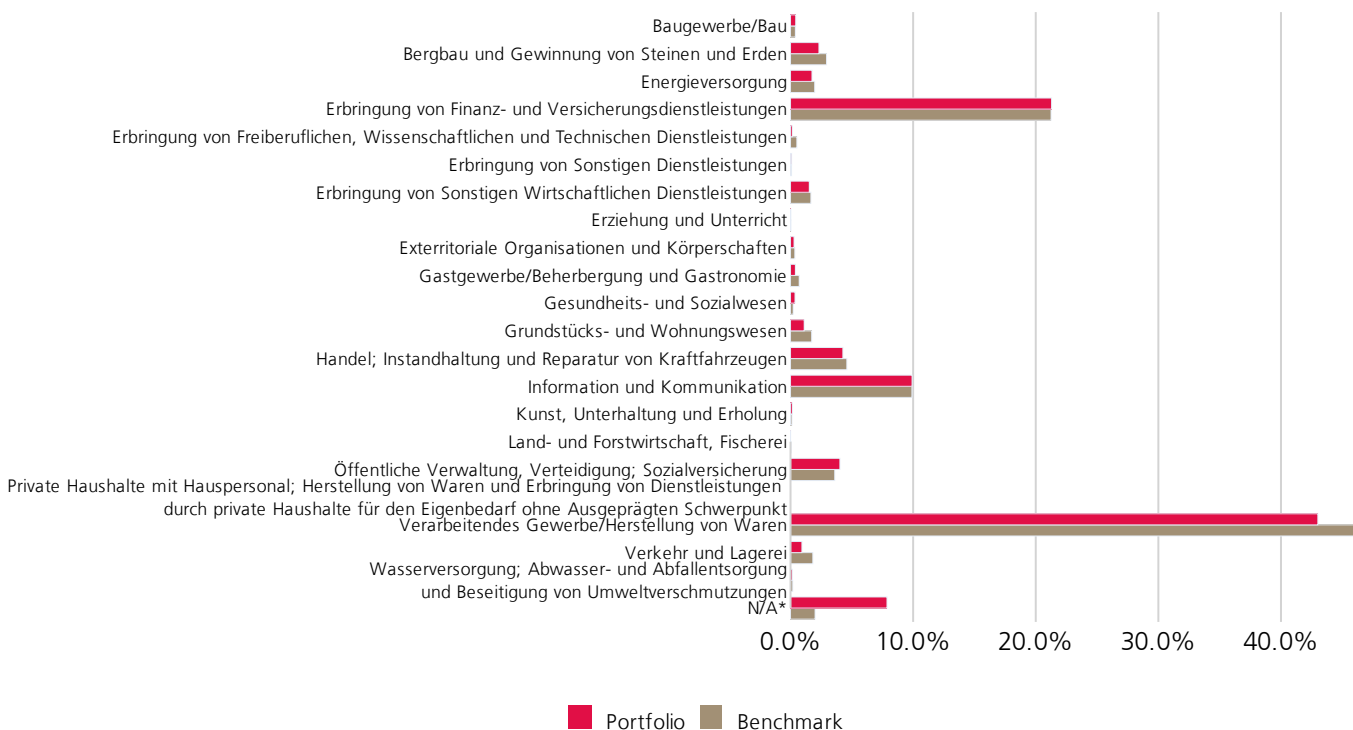
Der Anteil an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen und Angaben zur Vermögensallokation werden in untenstehender Frage beantwortet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Wegen mangelnder Datenverfügbarkeit können Subsektoren nicht angezeigt werden.



*Diese Klassifizierung umfasst alle Bestände, für die keine NACE-Klassifizierung gefunden oder geschätzt werden kann; Liquidität ist darin enthalten.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl keine Investitionen getätigt wurden, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind, wird in untenstehender Grafik die Alignierung der nachhaltigen Investitionen mit der EU-Taxonomie offengelegt.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja

In fossiles Gas

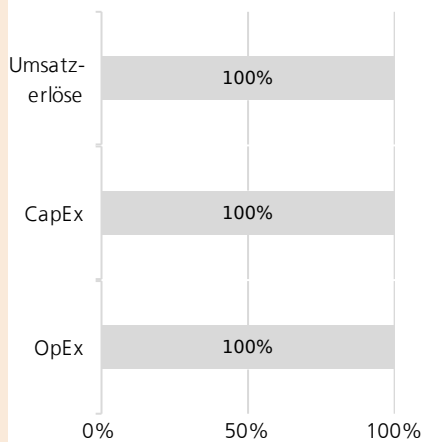
In Kernenergie

Nein

¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomeikonform, 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-taxonomeikonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

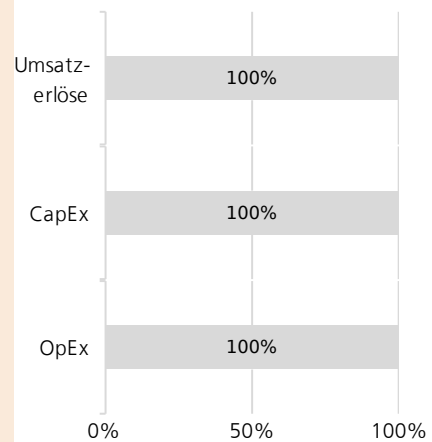
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomeikonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzproduktes einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzproduktes zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt 92.4% der Gesamtinvestitionen wieder.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Mit Blick auf die EU-Taxonomeikonformität 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 Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomeikonforme 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, z.B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben** (Opex), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Angaben zu Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten werden in der Tabelle zusammengefasst. Wenn keine Angaben verfügbar sind, wird die Tabelle ebenfalls keine Angaben enthalten.

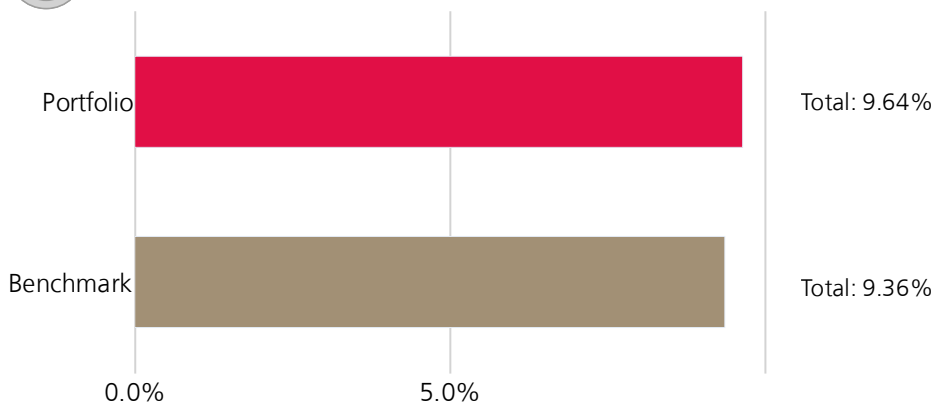
| Issuer Name | Nace Sektor | Total Eligible Activity Revenue | Total Aligned Revenue | Total Likely Aligned Revenue | Total Potentially Aligned Revenue | Portfolio Gewicht (Consol.) |
|--|---|---------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------|
| Elia Group SA/NV | Construction | 99.98% | 24.95% | 15.00% | 0.00% | 0.00% |
| Vestas Wind Systems A/S | Manufacturing | 100.00% | 24.00% | 0.00% | 75.00% | 0.00% |
| Terna S.p.A. | Water Supply, Sewerage, Waste Management and Remediation Activities | 87.76% | 21.75% | 13.10% | 0.00% | 0.01% |
| Redeia Corporacion SA | Construction | 84.35% | 19.80% | 12.73% | 0.00% | 0.09% |
| Orsted | Water Supply, Sewerage, Waste Management and Remediation Activities | 56.27% | 18.25% | 31.86% | 0.00% | 0.00% |
| Orsted A/S | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 56.27% | 18.25% | 31.86% | 0.00% | 0.00% |
| National Grid plc | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 19.17% | 16.75% | 0.00% | 0.36% | 0.03% |
| National Grid Electricity Distribution (South Wales) Plc | Financial and Insurance Activities | 19.17% | 16.75% | 0.00% | 0.36% | 0.00% |
| NGG Finance Plc | Financial and Insurance Activities | 19.17% | 16.75% | 0.00% | 0.36% | 0.00% |
| Klepierre SA | Real Estate Activities | 99.75% | 16.00% | 15.00% | 60.00% | 0.07% |

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?


Da im vorangegangenen Berichtsjahr keine Daten verfügbar waren, erübrigt sich ein Vorjahresvergleich.

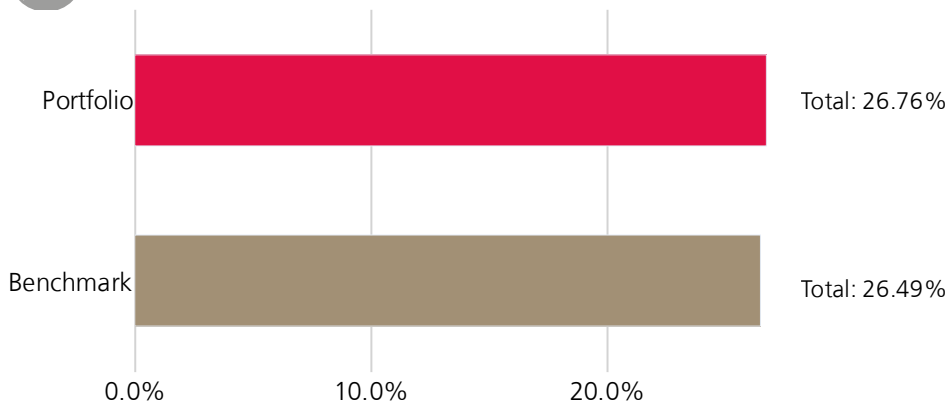
 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**




Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Diese Vermögenswerte haben die in der spezifischen Anlagepolitik vorgesehenen Anlagen umfasst, einschliesslich Derivate zu Absicherungszwecken und flüssige Mittel. Die Anlagen, ausgenommen Derivate und flüssige Mittel, haben die Grundsätze des ökologischen oder sozialen Mindestschutzes umgesetzt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Berichtszeitraum förderte das Asset Management durch Investment Stewardship und Kapitalallokation nachhaltige Geschäftspraktiken und die Einhaltung anerkannter internationaler Prinzipien und ESG-Best-Practice-Standards. Dementsprechend stand er im Dialog mit den Managementteams der investierten Unternehmen. Darüber hinaus hat er sich im Rahmen der United Nations Collaboration Platform for Responsible Investment (UN PRI) und bei Investoreninitiativen engagiert. Das Abstimmungsverhalten basierte auf den schweizerischen und internationalen Corporate-Governance-Regeln sowie auf den Prinzipien des UN Global Compact und den SDGs. Weitere Informationen finden Sie unter: [Swisscanto | Proxy Voting Dashboard \(issgovernance.com\)](https://www.swisscanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html)
<https://www.swisscanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>

Swisscanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com)

<https://www.swisscanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

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

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht anwendbar.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Nicht anwendbar.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht anwendbar.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht anwendbar.

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.