

Regelmäßige 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

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. 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 mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Name des Produkts:
Aktien USA II

Unternehmenskennung (LEI-Code):
213800ZK7A1XGTCD2U22

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

● ● Ja

● ● Nein

Es wurden damit **nachhaltige 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 wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% 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 wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**

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

Dieses Finanzprodukt zielt darauf ab, die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale (Ö/S-Merkmale) zu fördern:

- Ausschluss oder deutliche Reduzierung von Investitionen in Unternehmen mit umstrittenen Aktivitäten wie z. B. Tabak, Waffen (einschließlich, aber nicht beschränkt auf: zivile Schusswaffen, Atomwaffen, konventionelle Waffen und umstrittene Waffen)
- Ausschluss oder deutliche Reduzierung von Investitionen im Bereich der fossilen Brennstoffe
- Ausschluss oder deutliche Reduzierung von Investitionen in Unternehmen, die gegen die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen verstößen

Diese Ausschlüsse orientieren sich an den BVI-Ausschlüssen und der bewährten Praxis auf dem deutschen Markt.

Mindestens 75 % des Fondsvermögens werden Strategien zugewiesen, die einem Prozess folgen, der auf die Ö/S-Merkmale des Fonds abgestimmt ist. Mit anderen Worten, mindestens 75 % des Fonds entsprechen den oben genannten Kriterien.

Es wurde kein Referenzwert (Benchmark) für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale festgelegt.

Dieser Fonds hat das übergeordnete Ziel erreicht, indem 98.17 % des Fondsvermögens in Strategien investiert wurden, die einem Prozess folgen, der auf die Ö/S-Merkmale (einschließlich der oben genannten Ausschlusskriterien) abgestimmt ist.

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 Be- stechung.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Dieser Fonds hat das übergeordnete Ziel erreicht, indem 98.17% des Fondsvermögens (während des Berichtszeitraums) in Strategien investiert wurden, die einem Prozess folgen, der auf die Ö/S-Merkmale (einschließlich der oben genannten Ausschlusskriterien) abgestimmt ist.

Aufgrund der Einführung des Engagement-Programms im vierten Quartal 2024 wird ein vollständiges Reporting erst in der nächsten Berichtsrunde verfügbar sein, die sich auf den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2025 konzentrieren wird.

| Nr | PAI-Indikator | Messgröße | Bezugszeitraum 01.01. - 31.12.2024 |
|----|--|---|---------------------------------------|
| 1 | Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind % zu berücksichtigende Investitionen der gesamten Kapitalanlage: 98,77% % Investitionen mit erfassten Daten der gesamten Kapitalanlage: 92,27% | 0,00% |

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| Nr | PAI-Indikator | Bezugszeitraum 01.01. - 31.12.2024 | Bezugszeitraum 01.01. - 31.12.2023 | Bezugszeitraum 01.01. - 31.12.2022 |
|----|--|---------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 1 | Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 0,00% | n.v. | n.v. |

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Die Übereinstimmung des Fonds mit den Ö/S-Merkmalen hat sich seit dem Berichtszeitraum 2023 erhöht, und zwar von 96.97% auf 98.17%, was deutlich über der in den Ö/S-Merkmalen festgelegten Schwelle von 75% liegt.

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

Dieser Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen oder Investitionen, die mit der EU-Taxonomie übereinstimmen. Dieser Fonds ist zwar so konzipiert, dass er die Nachhaltigkeit unserer Umwelt und Gesellschaft im Sinne von Artikel 8 der SFDR berücksichtigt und dazu beiträgt, aber er ist nicht speziell darauf ausgerichtet, "nachhaltige Investitionen" im Sinne der SFDR zu tätigen oder Investitionen zu tätigen, die nach der EU-Taxonomie als "ökologisch nachhaltig" gelten.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**
Dieser Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.

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?

Bevor eine Anlageentscheidung getroffen wird, müssen unsere Anlageexperten eine Due-Diligence-Prüfung der vorgeschlagenen Anlageposition durchführen. Im Rahmen dieser Due-Diligence-Prüfung wird eine Vielzahl von Faktoren bewertet, darunter auch die Bewertung der vorgeschlagenen Anlageposition anhand der beiden unten aufgeführten Principal Adverse Impact (PAI)-Indikatoren (nachteilige Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren). Die verwendeten Indikatoren sind: (i) Schwere Kontroversen/Verstöße gegen den UN Global Compact und (ii) Engagement in umstrittenen Waffen. In einigen Fällen kann ein Finanzprodukt einen Dachfonds enthalten. Die oben aufgeführten PAIs wurden von Setanta auf der Grundlage der Anlagestrategie des Finanzprodukts definiert.



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: 01.01. - 31.12.2024

| Nr | ISIN | Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|----|--------------|---|-------------------------|-------------------------|--------------------|
| 1 | US5949181045 | MICROSOFT CORP COM USD0.0000125 | Informationstechnologie | 11,59% | Vereinigte Staaten |
| 2 | US67066G1040 | NVIDIA CORP COM USD0.001 | Informationstechnologie | 10,61% | Vereinigte Staaten |
| 3 | US0378331005 | APPLE COMPUTER CO COM NPV | Informationstechnologie | 10,25% | Vereinigte Staaten |
| 4 | US0231351067 | AMAZON COM INC COM USD0.01 | Zyklische Konsumgüter | 8,08% | Vereinigte Staaten |
| 5 | US02079K1079 | ALPHABET INC COM CL C | Kommunikationsdienste | 5,45% | Vereinigte Staaten |
| 6 | US11135F1012 | BROADCOM CORP COM USD1.00 | Informationstechnologie | 4,19% | Vereinigte Staaten |
| 7 | US30303M1027 | META PLATFORMS INC COM USD0.000006 CL 'A' | Kommunikationsdienste | 3,85% | Vereinigte Staaten |
| 8 | US57636Q1040 | MASTERCARD INC COM USD0.0001 CLASS 'A' | Finanzen | 2,84% | Vereinigte Staaten |
| 9 | US5324571083 | LILLY(ELI)& CO COM NPV | Gesundheitswesen | 2,57% | Vereinigte Staaten |

| | | | | | |
|----|--------------|---------------------------------|-------------------------|-------|--------------------|
| 10 | US92826C8394 | VISA INC COM STK USD0.0001 | Finanzen | 2,06% | Vereinigte Staaten |
| 11 | US88160R1014 | TESLA INC | Zyklische Konsumgüter | 2,03% | Vereinigte Staaten |
| 12 | US64110L1061 | NETFLIX COM INC COM USD0.001 | Kommunikationsdienste | 1,97% | Vereinigte Staaten |
| 13 | US46120E6023 | INTUITIVE SURGICAL COM USD0.001 | Gesundheitswesen | 1,65% | Vereinigte Staaten |
| 14 | US79466L3024 | SALESFORCE INC COM USD0.001 | Informationstechnologie | 1,60% | Vereinigte Staaten |
| 15 | US1273871087 | CADENCE DESIGN SYS COM USD0.01 | Informationstechnologie | 1,44% | Vereinigte Staaten |



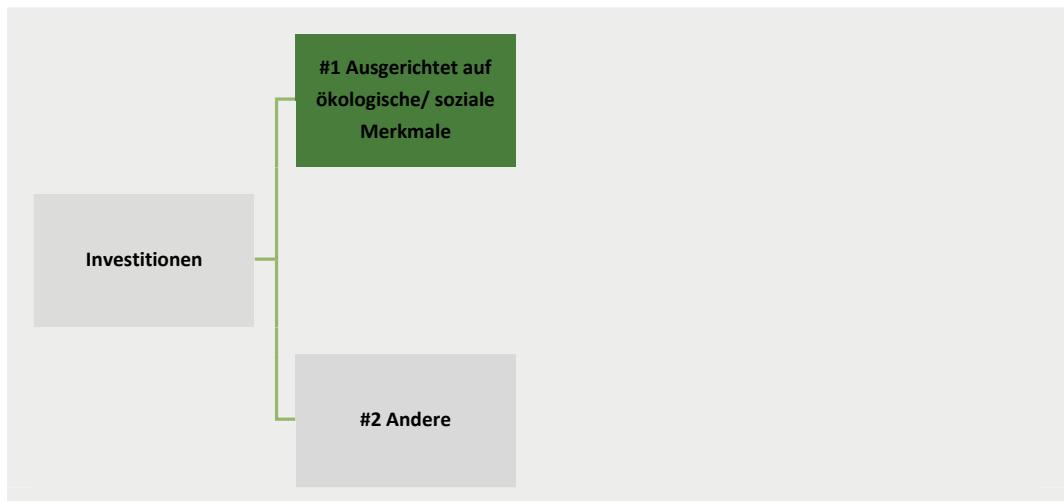
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Ziel ist eine Maximierung der Gesamterträge durch Anlage in ein Portfolio, das ganz oder vorwiegend aus Aktien von Gesellschaften aus der ganzen Welt besteht. Der Fonds konzentriert sich auf die USA. Die Förderung ökologischer oder sozialer Merkmale wurde in dieser Anlageklasse angewandt und wird gemäß der SFDR-Verordnung als Artikel 8 eingestuft.

Der Canada Life-Fonds investierte 98,17% seines Vermögens in Wertpapiere von Emittenten mit guten ESG-Eigenschaften (#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale). Alle weiteren Investitionen wurden den anderen Investitionen zugeordnet (#2 Andere). Dies entspricht 1,83% der Investitionen des Fonds.



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

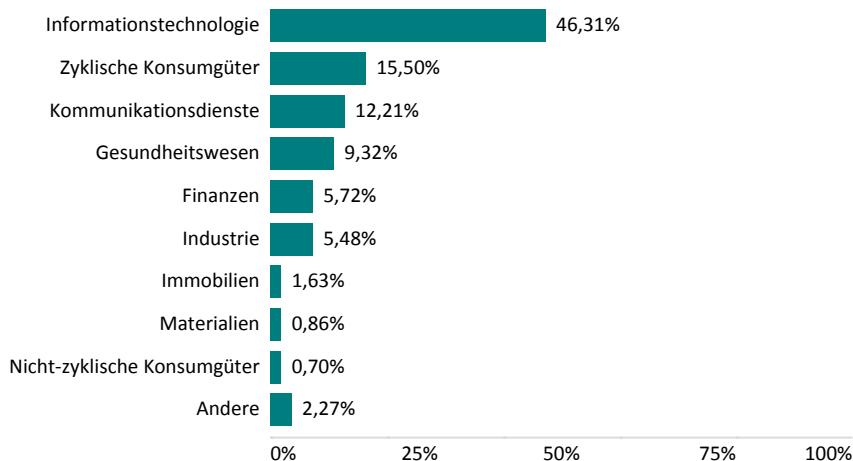
#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

- **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| Nr | Vermögensallokation - Anlageart | Bezugszeitraum | | Bezugszeitraum |
|----|---|---------------------|---------------------|----------------|
| | | 01.01. - 31.12.2024 | 01.01. - 31.12.2023 | |
| 1 | #1 Ausgerichtet auf ökologische/ soziale Merkmale | 98,17% | 96,97% | 96,41% |
| 2 | #2 Andere | 1,83% | 3,03% | 3,59% |

| | | | | |
|---|--|--------|--------|--------|
| 3 | #1A Nachhaltig | 0,00% | n.v. | n.v. |
| 4 | #1B Andere ökologische oder soziale Merkmale | 98,17% | 96,97% | 96,41% |
| 5 | Taxonomiekonform | 9,25% | n.v. | n.v. |
| 6 | Andere ökologische | n.v. | n.v. | n.v. |
| 7 | Soziale | n.v. | n.v. | n.v. |

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**



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

Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale fördert (Artikel 8 der SFDR), zielt die Investitionsstrategie des Fonds nicht ausdrücklich auf nachhaltige Investitionen ab, die mit den Kriterien der EU-Taxonomie übereinstimmen.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**

Ja:

In fossiles Gas

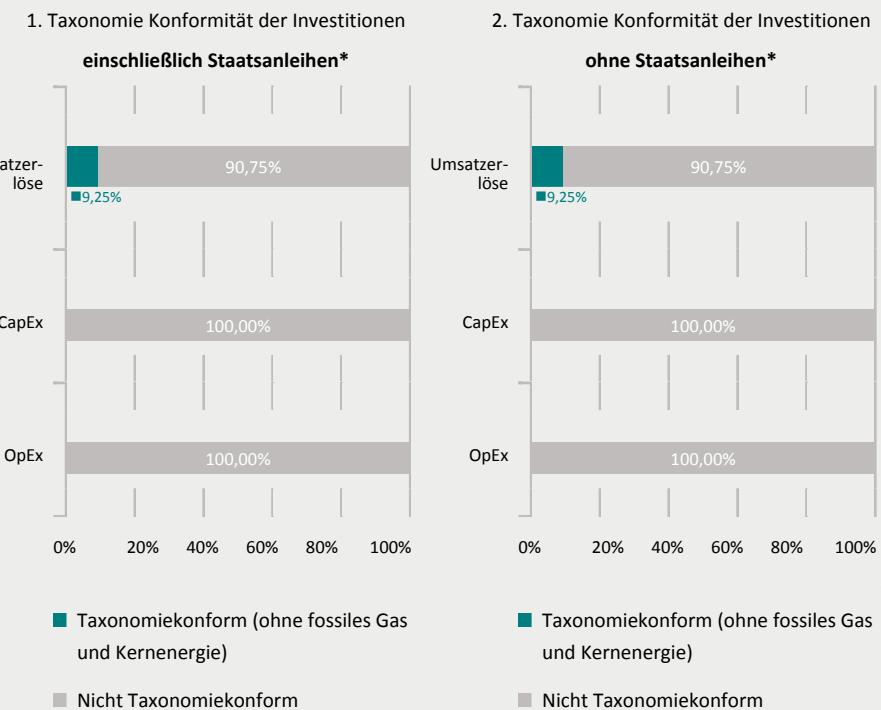
In Kernenergie

Nein

Ermöglichte Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichtend 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.

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

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen 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 Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Diese Grafik gibt 100,00% der Gesamtinvestitionen wieder.

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

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 links am 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.

• ...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

1. Taxonomie Konformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen

| Nr | Taxonomie-Indikator | Bezugszeitraum | |
|----|---------------------|---------------------|---------------------|
| | | 01.01. - 31.12.2024 | 01.01. - 31.12.2023 |
| | | 01.01. - 31.12.2022 | 01.01. - 31.12.2022 |

| | | | | |
|---|--|-------|-------|-------|
| 1 | Umsatz-Indikatoren | | | |
| | Taxonomiekonform: Fossiles Gas | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| | Taxonomiekonform: Kernenergie | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| | Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 9,25% | 0,00% | 0,05% |
| 2 | CapEx-Indikatoren | | | |
| | Taxonomiekonform: Fossiles Gas | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| | Taxonomiekonform: Kernenergie | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| | Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| 3 | OpEx-Indikatoren | | | |
| | Taxonomiekonform: Fossiles Gas | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| | Taxonomiekonform: Kernenergie | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| | Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,00% | 0,00% | 0,00% |

2. Taxonomie Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen

| Nr | Taxonomie-Indikator | Bezugszeitraum | Bezugszeitraum | Bezugszeitraum |
|----|--|---------------------|---------------------|---------------------|
| | | 01.01. - 31.12.2024 | 01.01. - 31.12.2023 | 01.01. - 31.12.2022 |
| 1 | Umsatz-Indikatoren | | | |
| | Taxonomiekonform: Fossiles Gas | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| | Taxonomiekonform: Kernenergie | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| | Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 9,25% | 0,00% | 0,05% |
| 2 | CapEx-Indikatoren | | | |
| | Taxonomiekonform: Fossiles Gas | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| | Taxonomiekonform: Kernenergie | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| | Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| 3 | OpEx-Indikatoren | | | |
| | Taxonomiekonform: Fossiles Gas | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| | Taxonomiekonform: Kernenergie | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| | Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,00% | 0,00% | 0,00% |

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermögliche Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Anteil der vom Fonds getätigten Investitionen in Übergangs- und Unterstützungsmaßnahmen betrug während des Berichtszeitraums 0 %.

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

Der Anteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind, beträgt 0,00 %.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen beträgt 0,00 %.



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 sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen beträgt 0,00 %.

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

Zu den als "#2 Andere Investitionen" klassifizierten Anlagen gehören ergänzende liquide Mittel (d. h. Barmittel und Barmitteläquivalente) und können Derivate für ein effizientes Portfoliomanagement, zur Absicherung und zur Liquiditätssicherung enthalten. Diese Anlagen sind Teil der Portfoliostrategie und ein wesentlicher Bestandteil des Risiko-/Ertragsrahmens der Strategie sowie der Deckung des Liquiditätsbedarfs des Fonds, d. h. der Bedienung von Zu- oder Abflüssen in bzw. aus dem Fonds. Für diesen Teil der Fondsanlagen gibt es keine spezifischen ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen.

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

Die Maßnahmen, die wir ergreifen, um sicherzustellen, dass der Fonds die von ihm unterstützten ökologischen oder sozialen Merkmale erfüllt, unterscheiden sich je nach Anlageklasse. Bei diesem Finanzprodukt handelt es sich um ein aktiv verwaltetes gemischtes Portfolio. Die Ö/S-Merkmale dieses Portfolios werden durch minimale Ausschlüsse erreicht.

Das Portfolio wird anhand der folgenden Mindestausschlüsse (Umsatzschwellen) von Setanta überprüft, um Wertpapiere zu identifizieren, die nicht gehalten werden dürfen.

Keine Rüstungsgüter aus Produktion und/oder Vertrieb > 10 % Umsatzerlöse

Keine Produktion von oder Beteiligung an illegalen Waffen (0 % Umsatzerlöse)

Keine Tabakproduktion > 5 % Umsatzerlöse

Keine Produktion von Kohle oder nichtkonventionellen fossilen Brennstoffen > 10 % Umsatzerlöse

Keine Verstöße gegen die Vorgaben des Global Compact der Vereinten Nationen

Alle aktiven Aktienbestände und Unternehmensanleihen fallen ebenfalls unter das Engagement- und Abstimmungsprogramm von Setanta sowie unter die Nachhaltigkeitsprüfungen (weitere Einzelheiten finden Sie in den vorvertraglichen Dokumenten gemäß SFDR).

Die oben genannten Ö/S-Merkmale werden regelmäßig überwacht und vierteljährlich an das Setanta Responsible Investment Committee berichtet.