

# 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.

**Name des Produkts:**  
Renten Dynamisch 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?

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

Dieses Finanzprodukt zielt darauf ab, die folgenden umweltbezogenen und/oder sozialen 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 in den Sektor der fossilen Brennstoffe und Ausschluss oder deutliche Reduzierung von Investitionen in Unternehmen, die gegen die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen. Die Indikatoren, mit denen die Ergebnisse dieses Ansatzes gemessen werden, sind die Verringerung der Treibhausgasintensität, aufgeschlüsselt nach Scope 1- und 2-Emissionen, und die Verringerung der Beteiligung des Portfolios an fossilen Brennstoffen im Vergleich zu einer adäquaten breiten Marktbenchmark. Wir schließen Unternehmen aus, die gegen die Prinzipien des United Nations Global Compact verstoßen.

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.

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Das ESG-Risiko-Rating misst das Ausmaß, in dem der wirtschaftliche Wert eines Unternehmens aufgrund der Nichtberücksichtigung von ESG-Faktoren gefährdet ist, indem es die nicht gemanagten ESG-Risiken des Unternehmens berechnet. Die Gesamtpunktzahl des ESG-Risikoratings für den Fonds ist 11.3 im Vergleich zur Marktbenchmark von 19.4 (eine niedrigere Punktzahl des Fonds deutet auf ein geringeres Maß an nicht gemanagtem ESG-Risiko und potenziellem Risiko für den wirtschaftlichen Wert hin). Die Kohlenstoffintensität ist eine Kennzahl, mit der die Emissionen von Unternehmen in verschiedenen Branchen verglichen werden können. Die absoluten Emissionen werden durch die Gesamteinnahmen geteilt, wobei die Zahlen in Tonnen Kohlendioxid-Äquivalent pro Million USD der Gesamteinnahmen ausgedrückt werden. tCO<sub>2</sub>/Mil USD für den Fonds ist 58.9 gegenüber der Marktbenchmark von 133.3. Die Beteiligung an fossilen Brennstoffen (gewichteter Durchschnitt) für den Fonds ist 0.08% gegenüber der Benchmark von 0.003%.

*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?**

Ziel des Fonds ist es, negative Auswirkungen auf die Umwelt und die Gesellschaft zu verringern. Diese negativen Auswirkungen werden auch als nachteilige Auswirkungen bezeichnet, wobei die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen als Hauptnachteile (principal adverse impacts - PAI) bezeichnet werden. Soweit möglich und machbar und in Übereinstimmung mit der Art der Investitionen wird eine Reihe von negativen Auswirkungen strukturell und systematisch als Teil der Investitionsentscheidungen des Fonds berücksichtigt. Diese Überlegungen finden statt, bevor Investitionsentscheidungen getroffen werden, und danach im Rahmen der laufenden Überwachung und Verwaltung der Investition, wenn eine Investition getätigt wurde. Anlageentscheidungen führen zu einer stärkeren Kapitalallokation in Unternehmen mit verbesserten PAI-Indikatoren als Ergebnis der Integration von ESG-Daten. Setanta berücksichtigt keine nachteiligen Auswirkungen seiner Anlageentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren auf Unternehmensebene. Setanta bewertet zwar die finanziell wesentlichen ESG-Themen für alle Unternehmen, achtet aber nicht darauf, dass die Unternehmen in allen von der SFDR definierten wesentlichen negativen Auswirkungen Nachhaltigkeitsergebnisse aus eigener Kraft erzielen.

Darüber hinaus ist die Berücksichtigung der vollständigen Liste der Indikatoren für die wichtigsten negativen Auswirkungen (PAI) nicht in allen Fällen mit unseren Kundenaufträgen vereinbar. Bei unserer Entscheidungsfindung berücksichtigen wir die folgenden wichtigen PAIs: (i) Treibhausgasintensität, aufgeschlüsselt nach Scope 1- und 2-Emissionen; (ii) Unterzeichner des UN Global Compact; (iii) Schwere Kontroversen/Verstöße gegen den UN Global Compact. 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. - 31.12.2022

Nr.	ISIN	Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
1	US9128283U26	US TREASURY N/B T 2 3/8 01/31/23		2,38%	Vereinigte Staaten
2	US912828XT22	US TREASURY N/B T 2 05/31/24		2,14%	Vereinigte Staaten
3	US337738BC18	FISERV INC FISV 2.65 06/01/30		1,96%	Vereinigte Staaten
4	XS2283177561	ZURICH FINANCE ZURNVX 3 04/19/51		1,86%	Irland
5	US9128286B18	WI TREASURY SEC. WIT 2 5/8 02/15/29		1,84%	Vereinigte Staaten
6	XS2431318802	LOGICOR FIN LOGICR 1 5/8 01/17/30		1,79%	Luxemburg
7	FR0014002RQ0	CNP ASSURANCES CNPFP 4 7/8 PERP		1,70%	Frankreich
8	USU55632AD24	MAGALLANES INC MGLLNS 3.755 03/15/27		1,69%	Vereinigte Staaten
9	IT0005367492	BTPS BTPS 1 3/4 07/01/24		1,68%	Italien
10	XS2193663619	BP CAPITAL PLC BPLN 4 1/4 PERP		1,52%	Vereinigtes Königreich
11	US74977SDL34	COOPERATIEVE RAB RABOBK 1.98 12/15/27		1,42%	Niederlande
12	JP1201751M13	JAPAN GOVT 20-YR JGB 0 1/2 12/20/40		1,34%	Japan
13	XS2193983108	UPJOHN FINANCE UPJOHN 1.908 06/23/32		1,31%	Niederlande
14	FR0014005RZ4	CRDT AGR ASSR ACAFP 1 1/2 10/06/31		1,30%	Frankreich
15	XS2342732562	VOLKSWAGEN INTFN VW 3.748 PERP		1,29%	Niederlande



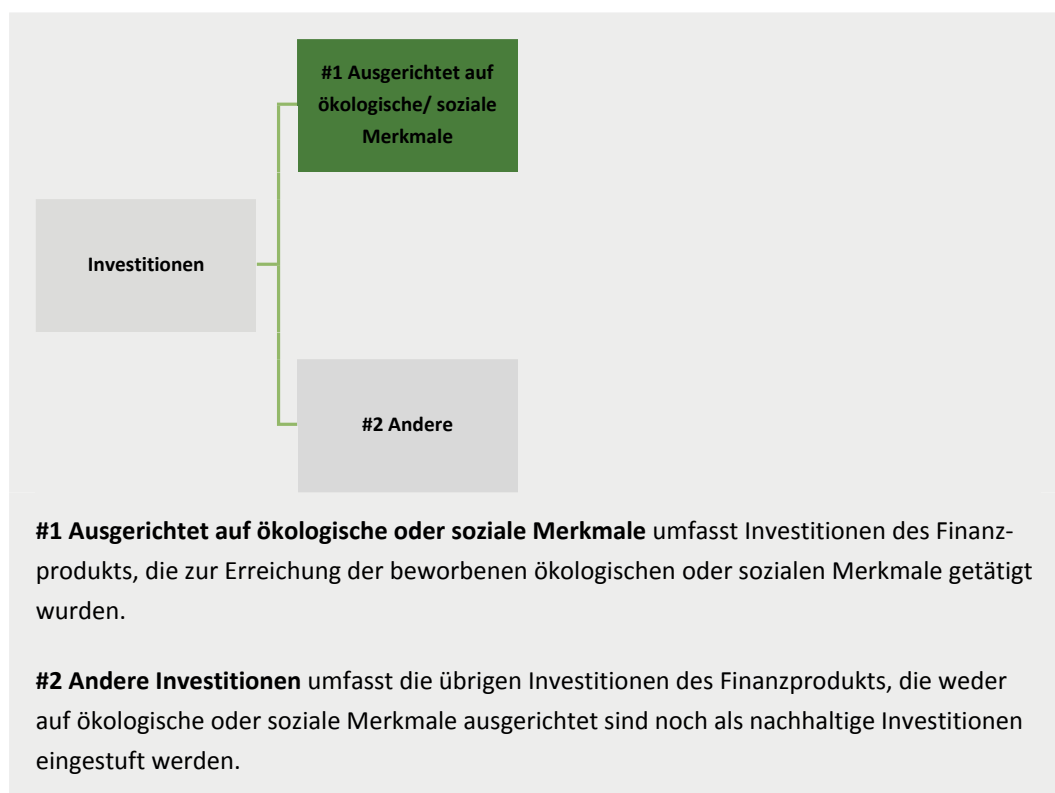
### Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

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

#### • Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Canada Life-Fonds investiert in renditestärkere festverzinsliche Anlagen, einschließlich Unternehmensanleihen, und ist bestrebt, seine ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen, indem er Investitionen in Unternehmen mit Engagements in bestimmten Aktivitäten, die als schädlich für die Umwelt oder die Gesellschaft angesehen werden, innerhalb des Portfolios einschränkt. Die Förderung ökologischer oder sozialer Merkmale wurde in dieser Anlageklasse angewandt und wird gemäß der SFDR-Verordnung als Artikel 8 eingestuft.

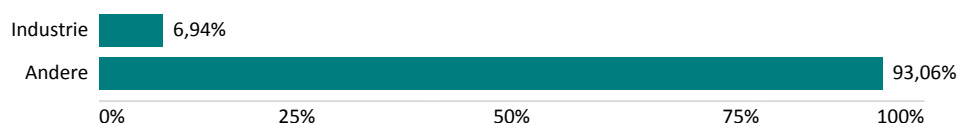
Der Canada Life-Fonds investierte 90,44% seines Vermögens in Wertpapiere von Emittenten mit guten ESG-Eigenschaften (#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale). Alle weiteren Investitionen wurden den anderen Investitionen zugeordnet (#2 Andere). Dies entspricht 9,56% der Investitionen des Fonds.



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

Das Engagement des Fonds in Unternehmen, die in den Sektoren der fossilen Brennstoffindustrie tätig sind, wird geschätzt auf 0,08 %. Dies ist ein ungünstiger Vergleich mit der breiten Marktbenchmark, die ein Engagement von 0,003 % aufweist.

Hinweis: ESG-Risikobewertungen und Kohlenstoffmetriken werden derzeit nur für Aktien und Unternehmensanleihen berechnet.



**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

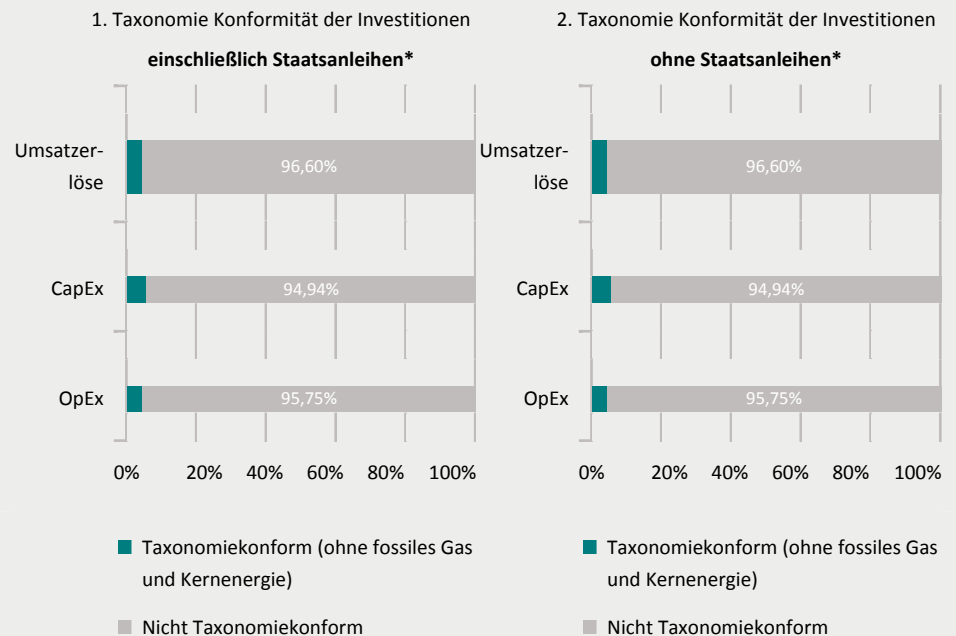
**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

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

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.

\*Tätigkeiten 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.

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

Der Anteil der vom Fonds getätigten Investitionen in Übergangs- und Unterstützungsmaßnahmen betrug während des Berichtszeitraums 0,00 %.



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

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

Da 2022 das erste Jahr der Berichterstattung ist, gibt es keine Vergleichszeiträume, die einen Vergleich zwischen dem regelmäßigen Bericht 2022 und den nachhaltigen Kennzahlen ermöglichen, die im regelmäßigen Bericht 2023 vorgelegt werden.



- **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 %.



- **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" 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. Dieser Teil kann aber auch eine kleine Anzahl von Anleihen enthalten. Es gibt bestimmte ökologische und soziale Mindestschutzmaßnahmen, die durch die Anwendung von ESG-Überlegungen im Rahmen unseres normalen Investment-Research-Prozesses erfüllt werden. Diese werden gegebenenfalls auf die zugrunde liegenden Wertpapiere angewandt.



- **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 vom Fonds geförderten ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht, sind je nach Anlageklasse unterschiedlich. Bei diesem Finanzprodukt handelt es sich um ein aktiv verwaltetes Mischportfolio. Die E/S-Merkmale des Global Equity-Portfolios werden durch Mindestausschlüsse erreicht. Das Global Equity Portfolio wird anhand der folgenden Kriterien überprüft, um alle Wertpapiere zu identifizieren, die nicht gehalten werden dürfen. Keine Rüstungsgüter > 10% , Keine geächteten Waffen 0% , Keine Tabakproduktion > 5% , Keine Kohle > 30% , Keine schwerwiegenden Verstöße gegen den UN Global Compact