

Precontractuele informatie voor de financiële producten als bedoeld in artikel 8, leden 1, 2 en 2 bis, van Verordening (EU) 2019/2088 en artikel 6, eerste alinea, van Verordening (EU) 2020/852

**Productnaam:**  
NT Global High Yield ESG Bond Index Fund  
**ISIN** IE00BJLFLJ28  
**Versie** 01/12/2023

**Identificatiecode juridische entiteiten:**  
549300HTX38J5YFFOL50

**Duurzame belegging:** een belegging in een economische activiteit die bijdraagt aan het behalen van een milieudoelstelling of een sociale doelstelling, mits deze belegging geen ernstige afbreuk doet aan milieu- of sociale doelstellingen en de ondernemingen waarin is belegd praktijken op het gebied van goed bestuur toepassen.

De **EU-taxonomie** is een classificatiesysteem dat is vastgelegd in Verordening (EU) 2020/852, waarbij een lijst van **ecologisch duurzame economische activiteiten** is vastgesteld. In de verordening is geen lijst van sociaal duurzame economische activiteiten vastgesteld. Duurzame beleggingen met een milieudoelstelling kunnen al dan niet in overeenstemming zijn met de taxonomie.

## Ecologische en/of sociale kenmerken (E/S-kenmerken)

Heeft dit financieel product een duurzame beleggingsdoelstelling?	
● ● <input type="checkbox"/> Ja	● ● <input checked="" type="checkbox"/> Nee
<input type="checkbox"/> Dit product zal minimaal de volgende <b>duurzame beleggingen met een ecologische doelstelling</b> doen: __% <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in economische activiteiten die volgens de EU-taxonomie als ecologisch duurzaam gelden</li> <li><input type="checkbox"/> in economische activiteiten die volgens de EU-taxonomie niet als ecologisch duurzaam gelden</li> </ul> <input type="checkbox"/> Dit product zal minimaal de volgende <b>duurzame beleggingen met een sociale doelstelling</b> doen: __%	<input checked="" type="checkbox"/> Dit product <b>promoot ecologische/sociale (E/S) kenmerken</b> . Hoewel duurzaam beleggen niet het doel ervan is, zal het een minimum van 5% duurzame beleggingen hebben <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> met een ecologische doelstelling in economische activiteiten die volgens de EU-taxonomie als ecologisch duurzaam gelden</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> met een ecologische doelstelling in economische activiteiten die volgens de EU-taxonomie niet als ecologisch duurzaam gelden</li> <li><input type="checkbox"/> met een sociale doelstelling</li> </ul> <input type="checkbox"/> Dit product promoot E/S-kenmerken, maar <b>zal niet duurzaam beleggen</b> .



### Welke ecologische en/of sociale kenmerken promoot dit financiële product?

NT Global High Yield ESG Bond Index Fund (het Product) heeft de volgende milieu- en/of sociale ("E/S") kenmerken: (i) het past uitsluitingen toe op het gebied van milieu, maatschappij en goed bestuur ("ESG") die van invloed zijn op het beleggingsuniversum van het product; en (ii) het sluit ondernemingen uit die geconfronteerd zijn met controverses in verband met ESGkwesties; (iii) het neigt naar ondernemingen met hogere ESG-ratings, en (iv) het neigt naar ondernemingen met een lagere koolstofuitstoot ten opzichte van de ICE BofAML Global High Yield Index (de "Index"). Als beleggingsstrategie tracht het product de risico- en rendementskenmerken van de Index te volgen - door rechtstreeks te beleggen in vrij overdraagbare schuld en schuldgerelateerde effecten, met inbegrip van obligaties onder investment grade die deel uitmaken van de Index - door gebruik te maken van een op steekproeven gebaseerd fysiek replicatiemodel. Zie de hieronder vermelde duurzaamheidsindicatoren voor meer details.

Duurzaamheidsindicatoren meten hoe de ecologische of sociale kenmerken die het financiële product promoot worden verwezenlijkt.

### ***Met welke duurzaamheidsindicatoren wordt de verwezenlijking van elk van de door dit financiële product gepromote ecologische of sociale kenmerken gemeten?***

Hieronder volgt een lijst van duurzaamheidsindicatoren die worden gebruikt om het bereiken van de door dit product bevorderde milieu- en/of sociale kenmerken te meten aan de hand van de aangepaste ESG-screeningscriteria van Northern Trust ("NT"):

- ondernemingen die wereldwijde normen zoals de tien beginselen van het Global Compact van de VN schenden omdat ze betrokken zijn bij controverses die als "zeer ernstig" worden geclassificeerd;
- bedrijven die enige inkomsten halen uit de productie van tabak, of 5% of meer van hun inkomsten uit de distributie van tabak, de levering van sleutelproducten voor de productie van tabak, of de detailhandel in tabak;
- bedrijven die controversiële wapens produceren, zoals clusterbommen, landmijnen, nucleaire wapens, wapens met verarmd uranium, biologische/chemische wapens, (of hun strategische componenten), verblindende laser, niet-detecteerbare componenten, of brandgevaarlijke wapens;
- bedrijven die civiele vuurwapens produceren of kleinhandel in civiele vuurwapens en 5% of meer inkomsten uit deze sector halen;
- bedrijven die conventionele wapens vervaardigen of ondersteunende diensten verlenen aan en 5% of meer inkomsten halen uit deze sector;
- bedrijven die 30% of meer van hun inkomsten halen uit kolengestookte energieopwekking of 5% of meer inkomsten als zij een risico op stranding van activa lopen;
- bedrijven die 5% of meer omzet halen uit For Profit Gevangenis en
- ondernemingen die zijn geclassificeerd als ondernemingen met "zeer ernstige" controverses in verband met klantenkwesties.

hierna de "NT Custom ESG screening criteria" genoemd.

Het product maakt gebruik van een optimalisatiemethode om effecten uitgegeven door bedrijven die toonaangevend zijn in de toepassing van ESG-principes te overwegen, waardoor de blootstelling aan effecten met een hogere ESG-rating wordt gemaximaliseerd en de belangrijkste risico's ten opzichte van de index worden gelijkgetrokken.

Om de koolstofvoetafdruk en andere negatieve externaliteiten te verminderen, streeft het product naar een vermindering van de operationele koolstofintensiteit van de portefeuille (gewogen gemiddelde koolstofintensiteit op basis van ton CO<sub>2</sub>e/\$M omzet); en dus een lagere koolstofvoetafdruk hebben ten opzichte van de Index. De beheerder zorgt er tevens voor dat alle beleggingen die het product overeenkomstig zijn strategie doet, in overeenstemming zijn met de regels inzake clustermuniteit die zijn vastgelegd in de relevante nationale wetgeving tot aanneming van het Verdrag inzake clustermuniteit. Hermes Equity Ownership Services is aangesteld voor het aangaan van samenwerkingsverbanden met zorgvuldig geselecteerde bedrijven die binnen het Product worden gehouden. Zie het Prospectus voor meer informatie over deze aanstelling. Deze duurzaamheidsindicatoren zijn niet uitputtend en kunnen worden gewijzigd.

### ***Wat zijn de doelstellingen van de duurzame beleggingen die het financiële product gedeeltelijk beoogt te doen en hoe draagt de duurzame belegging bij tot die doelstellingen?***

De beoogde doelstellingen van de duurzame investeringen zijn het leveren van een positieve bijdrage aan een van de onderstaande milieudoelstellingen. Onze definitie van positieve bijdrage omvat een minimumpercentage inkomsten uit activiteiten die verband houden met deze doelstellingen, naast ondernemingen waarvan is vastgesteld dat zij geloofwaardige doelstellingen inzake koolstofvermindering hebben, zoals het Science Based Targets Initiative ("SBTI").

- alternatieve energie (hernieuwbare energiebronnen),
- energie-efficiëntie,
- groen bouwen,
- duurzaam water,
- preventie van vervuiling en

duurzame landbouw Investeringen op deze gebieden dragen bij tot de verwezenlijking van de milieudoelstellingen van het product, met name de beperking van en de aanpassing aan de klimaatverandering.

### ***Hoe doen de duurzame beleggingen die het financiële product gedeeltelijk beoogt te doen geen ernstige afbreuk aan ecologische of sociaal duurzame beleggingsdoelstellingen?***

Om een investering als duurzame investering te beschouwen, moet deze niet alleen voldoen aan de positieve bijdragetest, maar ook aan een 'geen significante schade' ("DNSH") test die is ontworpen om ervoor te zorgen dat er geen significante schade wordt toegebracht aan enige milieu- of sociale investeringsdoelstelling.

Onze beoordeling van schade omvat het gebruik van een set diverse milieu- en sociale indicatoren, zoals bijvoorbeeld broeikasgasemissies ("GHG"), koolstofvoetafdruk, broeikasgasintensiteit van de investeerder, enzovoort, in combinatie met onze eigen drempelwaarden. Deze drempelwaarden vertegenwoordigen een waarde of maatstaf waarbij wij van mening zijn dat er een risico op significante schade bestaat. In de praktijk betekent dit dat een investeerder alleen als duurzame investering kan worden beschouwd volgens onze definitie als deze:

- a) voldoet aan onze minimale positieve bijdragetest;
- b) de indicatoren voor schade zich onder de drempelwaarden bevinden die op specifieke momenten zijn vastgesteld; en
- c) dat investeerdersbedrijven goede governance-praktijken volgen en in overeenstemming zijn met minimale waarborgen, zoals de richtlijnen van de Organisatie voor Economische Samenwerking en Ontwikkeling ("OECD") voor multinationale ondernemingen.

De belangrijkste ongunstige effecten zijn de belangrijkste negatieve effecten van beleggingsbeslissingen op duurzaamheidsfactoren die verband houden met ecologische en sociale thema's en arbeidsomstandigheden, eerbiediging van de mensenrechten en bestrijding van corruptie en omkoping.

### *Hoe is rekening gehouden met de indicatoren voor ongunstige effecten op duurzaamheidsfactoren?*

Het product houdt rekening met negatieve effecten via een reeks criteria die deel uitmaken van de beleggingsstrategie; de NT Custom ESG Screening criteria, ESG tilts om blootstelling aan effecten met een hogere ESG-rating en lagere koolstofuitstoot te maximaliseren en om het ESG-profiel te verbeteren. Deze schermen en tilts bieden een sterke ethische basis in overeenstemming met internationale normen en worden regelmatig bijgewerkt op basis van eigen onderzoek en feedback van onze cliënten. Bovendien hebben wij ons verzekerd van toegang tot een reeks aanbieders van ESG-gegevens en datasets om ons te helpen bij deze beoordeling en voortdurende controle.

Specifiek voor duurzame beleggingen, en zoals hierboven beschreven, omvat onze beoordeling van "do no significant harm" ("DNSH") het gebruik van een reeks uiteenlopende milieu- en sociale indicatoren met eigen drempels.

Ten slotte maakt de beoordeling van negatieve effecten deel uit van onze gerichte engagement- en stemactiviteiten die bedoeld zijn om de bedrijfsmodellen van ondernemingen waarin wordt geïnvesteerd te helpen bij de overgang naar een duurzamere toekomst.

### *Hoe zijn de duurzame beleggingen afgestemd op de OESO-richtsnoeren voor multinationale ondernemingen en de leidende beginselen van de VN inzake bedrijfsleven en mensenrechten? Details:*

Het product past de NT Custom ESG-screeningmethode toe om bedrijven te identificeren en uit te sluiten die zich niet houden aan internationale normen - zoals:

- OESO-richtlijnen voor multinationale ondernemingen;
- de UN Guiding Principles on Business and Human Rights, inclusief de beginselen en rechten die zijn vastgelegd in de acht fundamentele conventies die in de Verklaring van de Internationale Arbeidsorganisatie (ILO) over de fundamentele beginselen en rechten op het werk zijn vastgelegd; en
- de Internationale Bill of Human Rights.

De uitvoering van deze uitsluitingen gebeurt door het gebruik van controledata van derden die worden gebruikt als maatstaf voor de beoordeling van de negatieve gevolgen van de activiteiten, producten en diensten van een onderneming op milieu-, sociaal en bestuurlijk gebied. In de praktijk betekent dit dat alle ondernemingen waarin wordt geïnvesteerd aan deze minimumwaarborgen voldoen, niet alleen de duurzame investeringen.

In de EU-taxonomie is het beginsel "geen ernstige afbreuk doen" vastgesteld, dat inhoudt dat op taxonomie afgestemde beleggingen geen ernstige afbreuk mogen doen aan de doelstellingen van de EU-taxonomie en dat vergezeld gaat van specifieke EU-criteria.

Het beginsel "geen ernstige afbreuk doen" is alleen van toepassing op de onderliggende beleggingen van het financiële product die rekening houden met de EU-criteria voor ecologisch duurzame economische activiteiten. De onderliggende beleggingen van het resterende deel van dit financiële product houden geen rekening met de EU-criteria voor ecologisch duurzame economische activiteiten.



## Houdt dit financiële product rekening met de belangrijkste ongunstige effecten op duurzaamheidsfactoren?

Ja

Via de NT Custom ESG screening criteria methodologie houdt het product zich aan internationale normen door te screenen op schendingen van UN Global Compact principes en Organisatie voor Economische Samenwerking en Ontwikkeling (OESO).

Daarnaast sluit de methodologie een reeks ondernemingen uit waarvan is vastgesteld dat hun bedrijfsactiviteiten aanzienlijke schade aan het milieu of de samenleving toebrengen, zoals blootstelling aan controversiële wapens (antipersoneelsmijnen, clustermunitie, chemische wapens en biologische wapens) en vastgestelde gevallen van ernstige mensenrechtenkwesties en -incidenten. In het kader van zijn beleggingsstrategie houdt het product rekening met de uitstoot van broeikasgassen (Scope 1 en Scope 2), de koolstofvoetafdruk en de broeikasgasintensiteit van ondernemingen waarin wordt geïnvesteerd.

Ten slotte maken negatieve effecten ook deel uit van onze gerichte betrokkenheid en stemactiviteit, waardoor wij kunnen vaststellen waar middelen het best kunnen worden ingezet voor een maximaal sociaal en/of milieueffect.

Nee



## Welke beleggingsstrategie hanteert dit financiële product?

### De beleggingsstrategie

stuurt beleggingsbeslissing en op basis van factoren als beleggingsdoelstellingen en risicotolerantie.

Het product is een passieve indexvolgstrategie waarbij het de risico- en rendementskenmerken van de index - de ICE BofAML Global High Yield Index - tracht te volgen door rechtstreeks te beleggen in vrij overdraagbare schuld en schuldgerelateerde effecten, waaronder investment grade obligaties die deel uitmaken van de index. Het product tracht zijn beleggingsdoelstellingen te bereiken door hoofdzakelijk te beleggen in vrij overdraagbare schuld en schuldgerelateerde effecten, waaronder investment grade obligaties die deel uitmaken van de Index. De Index wordt gescreend op basis van door Northern Trust geselecteerde ESG-criteria die het bedrijven uitsluit die niet aan bepaalde duurzaamheidsprincipes voldoen. Het product maakt gebruik van een optimalisatiemethode om effecten uitgegeven door bedrijven die leiders zijn in het implementeren van ESG-principes te overwegen, waardoor de blootstelling aan effecten met hogere ESG-ratings wordt gemaximaliseerd, terwijl de belangrijkste risico's ten opzichte van de Index op elkaar worden afgestemd. Het product beoogt de operationele koolstofintensiteit van de portefeuille te verminderen (gewogen gemiddelde koolstofintensiteit gebaseerd op ton CO<sub>2</sub>e/\$M omzet); en dus een lagere koolstofvoetafdruk te hebben ten opzichte van de Index. Het product streeft er onder meer naar klimaatgerelateerde risico's te minimaliseren en klimaatgerelateerde kansen maximaliseren door te beleggen in vastrentende effecten van beleggingskwaliteit effecten met hogere of verbeterende ESG-profielen met een lagere koolstofvoetafdruk ten opzichte van de Index.

### ***Welke bindende elementen van de beleggingsstrategie zijn bij het selecteren van de beleggingen gebruikt om te voldoen aan alle ecologische en sociale kenmerken die dit financiële product promoot?***

De bindende elementen van de strategie ter bevordering van de milieu- of sociale kenmerken maken deel uit van het beleggingsuniversum. Dit betekent dat het beleggingsuniversum is gescreend volgens specifieke ESG-criteria die bedoeld zijn om specifieke milieu- en/of sociale doelstellingen te bevorderen en negatieve effecten te beperken of te vermijden. De negatieve ESG-screening en de doelstellingen op het gebied van koolstofemissiereductie zijn gecodeerd in ons orderbeheersysteem. Voorbeelden van bindende elementen zijn de uitsluiting van een reeks ondernemingen, of sectoren, meestal gebaseerd op een voorgeschreven omzeldrempel en uitgebreid tot ondernemingen die:

- niet voldoen aan de UN Global Compact Principles;
- inkomsten halen uit de productie of distributie van tabak;
- civiele vuurwapens, controversiële en conventionele wapens produceren
- inkomsten halen uit de winning van thermische kolen en steenkool.

Zie het eerdere antwoord op de vraag over "duurzaamheidsindicatoren" voor een volledige lijst van de aangepaste ESG-uitsluitingen die deel uitmaken van de bindende criteria van het product.

### ***Met welk toegezegd minimumpercentage wordt de ruimte voor in overweging te nemen beleggingen beperkt vóór de toepassing van die beleggingsstrategie?***

Het beleggingsuniversum van het product wordt weliswaar verkleind als gevolg van de bindende uitsluitingen, maar het verplicht zich niet tot een minimale verkleining. Als zodanig kan de vermindering van het universum aan verandering onderhevig zijn.

### ***Wat is het beleid om praktijken op het gebied van goed bestuur te beoordelen voor de ondernemingen waarin is belegd?***

Een beoordeling van goed bestuur van ondernemingen waarin wordt belegd, vormt een fundamenteel onderdeel van de methode van de NT Custom ESG Index-methodologie. In de praktijk wordt dit bereikt door het gebruik van onze ESG Controversy-scherm van onze dataleverancier, een proxy-raamwerk dat is ontworpen voor de aanpak van bestuursonderwerpen die in overeenstemming zijn met de internationale normen van de VN Verklaring van de Rechten van de Mens, de ILO-verklaring inzake fundamentele beginselen en rechten op het werk, de OESO-richtlijnen en het Global Compact van de VN. Om de controverses te produceren, beoordeelt de door ons gekozen gegevensverstrekker de negatieve milieu-, sociale en governance-impact van de activiteiten van de ondernemingen waarin wordt geïnvesteerd, producten en diensten. Hij identificeert ook schendingen van internationale normen door het gebruik van controlemaatstaven die worden beoordeeld op basis van de omvang en de ernst van de controverses. De ernst kan variëren afhankelijk van de aard van de controverses, maar omvat in het algemeen maatstaven zoals: - het percentage aandeelhoudersstemmen of het aantal aandeelhouders dat een mening geeft, - aantal en positie van betrokken leidinggevenden of bestuurders, - het aantal en het soort externe partijen die zich uitspreken, of - het deel van de onderneming dat wordt geraakt of betrokken is. Voor andere bestuurskwesties wordt de omvang doorgaans afgemeten aan: - de duur van een activiteit, - de omvang van de betrokken markt of overheid, of - de schaal waarop ofwel bedrijfsleiders of externe partijen zoals ambtenaren betrokken waren.

Praktijken op het gebied van **goed bestuur** omvatten goede managementstructuren, betrekkingen met werknemers, beloning van het betrokken personeel en naleving van de belastingwetgeving.

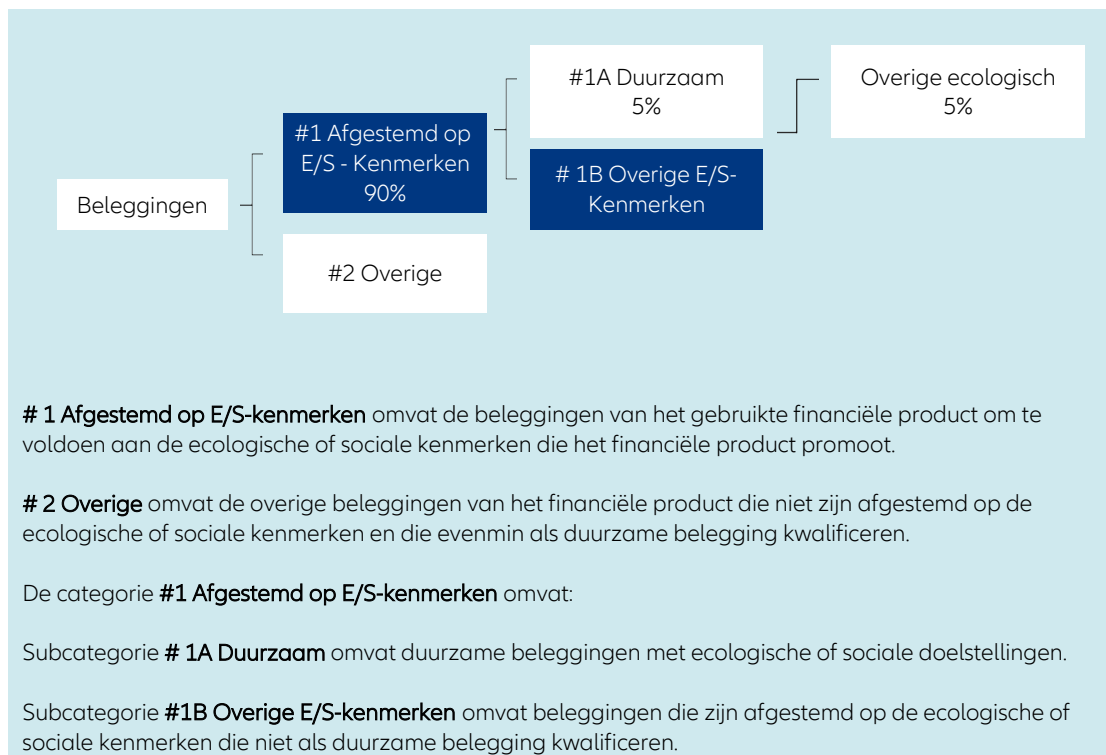


### **Welke activa-allocatie is er voor dit financiële product gepland?**

De **activa-allocatie** beschrijft het aandeel beleggingen in bepaalde activa.

Het product wil voor ten minste 95%-99% belegd zijn in emittenten met verbeterde ESG-kenmerken. Voor bedrijven is deze allocatie het resultaat van een reeks bindende positieve tilts en uitsluitingen die op de Index worden toegepast om het ESG-beleggingsuniversum te bereiken. Dit omvat ook ondernemingen die zich houden aan de internationale normen van de VN-verklaring van de rechten van de mens, de IAO-verklaring inzake fundamentele beginselen en rechten op het werk, de OESORichtlijnen en het Global Compact van de VN. Hiervan zal minimaal 5% worden belegd in duurzame beleggingen met een milieudoelstelling. Het product is momenteel voornemens 0% van zijn activa te beleggen in beleggingen die bijdragen tot ecologisch duurzame economische activiteiten overeenkomstig de Taxonomieverordening. De "overige" 1%-5% van het product zal naar verwachting bestemd zijn voor kasmiddelen, hedging en andere nevendoeleinden.

Op de taxonomie afgestemde activiteiten worden uitgedrukt als aandeel van:  
- de **omzet** die het aandeel weergeeft van de opbrengsten uit groene activiteiten van ondernemingen waarin is belegd;  
- de **kapitaaluitgaven** (CapEx) die laten zien welke groene beleggingen worden gedaan door de ondernemingen waarin is belegd, bv. voor een transitie naar een groene economie;  
- de **operationele uitgaven** (OpEx) die groene operationele activiteiten van ondernemingen waarin is belegd, weergeven.



**# 1 Afgestemd op E/S-kenmerken** omvat de beleggingen van het gebruikte financiële product om te voldoen aan de ecologische of sociale kenmerken die het financiële product promoot.

**# 2 Overige** omvat de overige beleggingen van het financiële product die niet zijn afgestemd op de ecologische of sociale kenmerken en die evenmin als duurzame belegging kwalificeren.

De categorie **#1 Afgestemd op E/S-kenmerken** omvat:

Subcategorie **# 1A Duurzaam** omvat duurzame beleggingen met ecologische of sociale doelstellingen.

Subcategorie **#1B Overige E/S-kenmerken** omvat beleggingen die zijn afgestemd op de ecologische of sociale kenmerken die niet als duurzame belegging kwalificeren.

**Hoe worden met het gebruik van derivaten de ecologische of sociale kenmerken verwezenlijkt die het financiële product promoot?**

Het product maakt geen gebruik van derivaten.



**In hoeverre zijn duurzame beleggingen met een ecologische doelstelling minimaal op de EU-taxonomie afgestemd?**

Het product wil momenteel 0% van zijn activa beleggen in investeringen die bijdragen tot ecologisch duurzame economische activiteiten in overeenstemming met de Taxonomie Verordening.

Om te bepalen of aan de EU-taxonomie wordt voldaan, bevatten de criteria voor fossiel gas emissie-grenswaarden en de omschakeling op hernieuwbare energie of koolstofarme brandstoffen tegen eind 2035. Voor kernenergie bevatten de criteria uitgebreide regels inzake veiligheid en afvalbeheer.

Faciliterende activiteiten maken het rechtstreeks mogelijk dat andere activiteiten een substantiële bijdrage leveren aan een milieudoelstelling.

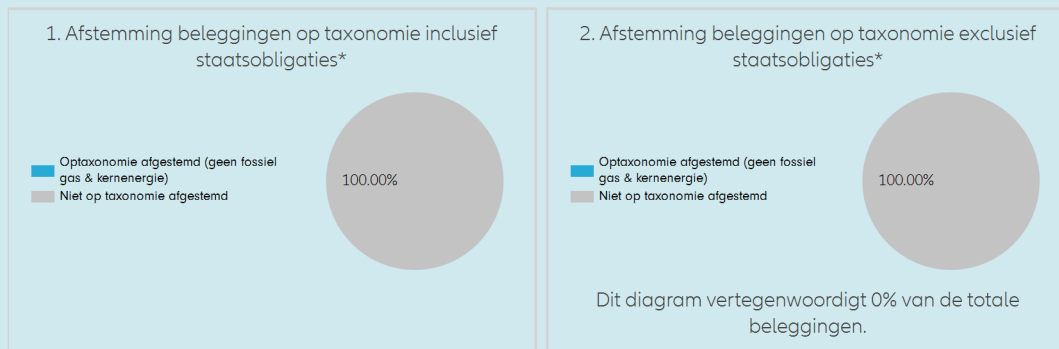
Transitieactiviteiten zijn activiteiten waarvoor nog geen koolstofarme alternatieven beschikbaar zijn en die onder meer broeikasgasemissie-niveaus hebben die overeenkomen met de beste prestaties.

zijn duurzame beleggingen met een milieudoelstelling die geen rekening houden met de criteria voor ecologisch duurzame economische activiteiten in het kader van de EU-taxonomie.

## Belegt het financiële product in activiteiten in de sectoren fossiel gas en/of kernenergie die aan de EU-taxonomie voldoen<sup>1</sup>?

- Ja
- In fossiel gas  In kernenergie
- Nee

De twee onderstaande diagrammen geven in het blauw het minimumpercentage op de EU-taxonomie afgestemde beleggingen. Er is geen geschikte methode om te bepalen in hoeverre staatsobligaties\* op de taxonomie zijn afgestemd. Daarom geeft het eerste diagram de mate van afstemming voor alle beleggingen van het financiële product inclusief staatsobligaties, terwijl het tweede diagram alleen voor de beleggingen van het financiële product in andere producten dan staatsobligaties aangeeft in hoeverre die op de taxonomie zijn afgestemd.



\* In deze diagrammen omvat "staatsobligaties" alle blootstellingen aan overheden.

### Wat is het minimumaandeel beleggingen in transitie- en faciliterende activiteiten?

Dit is niet van toepassing aangezien het product momenteel voornemens is 0% van zijn activa te beleggen in investeringen die bijdragen tot ecologisch duurzame economische activiteiten overeenkomstig de taxonomieverordening, waaronder 0% van zijn activa in faciliterende activiteiten en 0% van zijn activa in transitieactiviteiten ter beperking van de klimaatverandering.



### Wat is het minimumaandeel duurzame beleggingen met een ecologische doelstelling die niet op de EU-taxonomie zijn afgestemd?

Naar verwachting zal 0% van de verbintenis inzake duurzame productinvesteringen worden afgestemd op de EU-taxonomie. Op basis hiervan zal de toezegging van 10% naar verwachting niet worden afgestemd op de EU-taxonomie.



### Wat is het minimumaandeel van sociaal duurzame beleggingen?

Het product richt zich niet op sociaal duurzame investeringen en verwacht derhalve 0% investeringen in sociaal duurzame beleggingen.

<sup>1</sup> Activiteiten in de sectoren fossiel gas en/of kernenergie zullen alleen aan de EU-taxonomie voldoen indien zij bijdragen aan het beperken van de klimaatverandering ("klimaatmitigatie") en geen ernstige afbreukdoen aan de doelstellingen van de EU-taxonomie - zie de toelichting in de li nker marge. De uitgebreide criteria voor economische activiteiten in de sectoren fossiel gas en kernenergie die aan de EU-taxonomie voldoen, zijn vastgesteld in Gedelegeerde Verordening (EU) 2022/1214 van de Commissie.





## Welke beleggingen zijn opgenomen in "#2 Overige"? Waarvoor zijn deze bedoeld en bestaan er ecologische of sociale minimumwaarborgen?

Cash is het enige investeringstype dat wordt gecategoriseerd als "overig" en is niet afgestemd op milieu- of sociale kenmerken, noch kwalificeert het als duurzame investeringen. Bovendien worden geen minimale milieu- of sociale waarborgen toegepast. Beleggingen kunnen om de volgende redenen als "overig" worden aangemerkt: - Geldmiddelen en kasequivalenten of geldmarktinstrumenten: Het product kan beleggen in liquide middelen zoals depositocertificaten en termijndeposito's en geldmarktinstrumenten.



## Is er een specifieke index als referentiebenchmark aangewezen om te bepalen of dit financiële product is afgestemd op de ecologische en/of sociale kenmerken die dit financiële product promoot?

Nee, het product heeft geen specifieke index die is aangewezen als referentiebenchmark met ESGkenmerken. Het product wordt beheerd tegen de ICE BofAML Global High Yield Index; daarom is dit onderdeel niet van toepassing aangezien het product geen ESG-referentiebenchmark heeft.

### *Hoe wordt de referentiebenchmark doorlopend afgestemd op alle ecologische of sociale kenmerken die dit financiële product promoot?*

Het product heeft geen specifieke index aangewezen als referentiebenchmark. De NT Custom ESG screening criteria is echter een lijst van bedrijven die worden uitgesloten van het beleggingsuniversum op basis van de geselecteerde ESG-criteria op basis van ESG Research gegevens per respectievelijk eind januari, april, juli en oktober. Voor sommige effecten is het mogelijk dat deze gegevens aan het einde van de maand voorafgaand aan de Indexherziening nog niet zijn gepubliceerd. Voor dergelijke effecten zal de gegevensverstrekker ESG-gegevens gebruiken die na het einde van de maand worden gepubliceerd, indien beschikbaar. Wij evalueren de ESG-criteria met regelmatige herzieningen om ervoor te zorgen dat deze blijven aansluiten bij elk van de milieu- of sociale kenmerken die door het product worden bevorderd.

### *Hoe wordt geborgd dat de beleggingsstrategie doorlopend op de methode van de index afgestemd blijft?*

De afstemming van de beleggingsstrategie wordt gewaarborgd door de codering van de ESGschermen en tilts waarin de verschillende bindende ESG-criteria zijn verwerkt. Dit betekent dat het product elk effect in het resulterende belegbare universum kan bezitten (effecten die niet aan de specifieke criteria voldoen, komen niet in het universum voor). Naast de toepassing van de ESG-criteria stemt het product de belangrijkste risico's ten opzichte van de index op elkaar af, waaronder duurtijd, rendement, voor opties aangepaste spreiding en kredietkwaliteit. Bij de optimalisatie wordt ook gestreefd naar landengewichten, sectorgewichten en emittentengewichten die die van de Index benaderen. Bovendien worden beleggingsrichtlijnen en -restricties gecodeerd in ons orderbeheersysteem om controle vooraf en achteraf mogelijk te maken.

### *Waarin verschilt de aangewezen index van een relevante brede marktindex?*

Dit is niet van toepassing aangezien het product wordt beheerd tegen de ICE BofAML Global High Yield Index. De NT Custom ESG-schermen zijn bedoeld om effecten die niet voldoen aan onze ESG-criteria uit het beleggingsuniversum te weren.

### *Waar is de voor de berekening van de aangewezen index gebruikte methodologie te vinden?*

Dit is niet van toepassing aangezien het product geen aangewezen index heeft.



## Waar kan ik online meer specifieke informatie over dit product vinden?

Andere productspecifieke informatie is te vinden op de website:

<https://www.allianz.nl/zakelijk/verzekeringen/pensioen/duurzaam.html> of op de website van de beheerders: <https://www.northerntrust.com/united-kingdom/what-we-do/investment-management/pooled-funds>