

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

Name des Produkts: Vontobel Fund II - Megatrends

Unternehmenskennung (LEI-Code): 222100SVUS66GC1A1O71

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

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: ____%

Nein

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.**

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.



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

Die von dem Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wurden erfüllt.

Der Teilfonds bewarb ökologische und soziale Merkmale und investierte in Emittenten, die nach Ansicht des Anlageverwalters gut aufgestellt sind, um finanziell wesentliche ökologische und soziale Herausforderungen zu bewältigen. Die Emittenten wurden auf Grundlage des ESG-Rahmens des Anlageverwalters ausgewählt.

Der Teilfonds hat keinen Referenzwert für die Erreichung der von ihm beworbenen

ökologischen und sozialen Merkmale festgelegt.

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

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Indikator	Beschreibung	Wert	Kommentar
Prozentsatz der Anlagen in Wertpapiere von Unternehmensemittenten die einen nicht unerheblichen Teil ihrer Erträge aus Produkten und/oder Aktivitäten erzielen, die vom Teilfonds ausgeschlossen sind	Weitere Informationen zu den vom Teilfonds ausgeschlossenen Produkten und Aktivitäten sind den vorvertraglichen Informationen zu entnehmen.	0%	Der in der Anlagestrategie definierte Ausschlussansatz ermöglicht es dem Teilfonds, Ausnahmen für Unternehmen zu machen, die über eine Strategie zur Klimawende verfügen. 1,29 Prozent des Nettovermögens (Nextera Energy und RWE) stehen auf der Ausnahmeliste des Anlageverwalters.
Prozentsatz der Anlagen in Wertpapieren von Unternehmensemittenten, die das für diesen Teilfonds festgelegte Mindest-ESG-Rating von MSCI erfüllen	Als MSCI-ESG-Mindeststrating wurde B festgelegt.	99.10%	0,90 Prozent verfügten nicht über ein Rating von MSCI ESG
Prozentsatz der Anlagen in Emittenten, die gegen bestimmte internationale Normen und Standards verstossen, die vom Teilfonds unterstützt werden, oder die schwerwiegenden Kontroversen ausgesetzt sind.	Solche Kontroversen können mit Umwelt-, Sozial- oder Governance-Themen zusammenhängen.	0%	
Prozentsatz der von der ESG-Analyse erfassten Wertpapiere		99.10%	0,90 Prozent verfügten nicht über ein Rating von MSCI ESG

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Indikator	Geschäftsjahresende 31. März 2022
Prozentsatz der Anlagen in Wertpapiere von Unternehmensemittenten, die einen nicht unerheblichen Teil ihrer Erträge aus Produkten und/oder Aktivitäten erzielen, die vom Teilfonds ausgeschlossen sind	N/A
Prozentsatz der Anlagen in Wertpapieren von Unternehmensemittenten, die das für diesen Teilfonds festgelegte Mindest-ESG-Rating von MSCI erfüllen	N/A
Prozentsatz der Anlagen in Emittenten, die gegen bestimmte internationale Normen und Standards verstossen, die vom Teilfonds unterstützt werden, oder die schwerwiegenden Kontroversen ausgesetzt sind.	N/A
Prozentsatz der von der ESG-Analyse erfassten Wertpapiere	N/A

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

N/A

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

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

N/A

- *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:*

N/A

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien 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?

Der Anlageverwalter berücksichtigte eine Reihe der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den folgenden Bereichen: **umstrittene Waffen** (Tabelle 1 – PAI-Indikator 14, Anteil der Investitionen in Unternehmen, die an umstrittenen Waffen beteiligt sind), **Soziales und Menschenrechte** (Tabelle 1 – PAI-Indikator 10, Anteil der Investitionen in Unternehmen, die an Verstößen gegen die Grundsätze des UN Global Compact oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt sind).

Der Anlageverwalter folgte einem Prozess zur Identifizierung von Emittenten, die den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren ausgesetzt sind. Dieser Prozess basiert auf internem Research und/oder externen Datenquellen, einschliesslich ESG-Datenanbietern, Nachrichtenmeldungen und den Emittenten selbst.

In der Berichtsperiode wurden für keine Beteiligung wesentliche und unzureichend gesteuerte Auswirkungen in einem der berücksichtigten Bereiche der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen festgestellt.



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: er 31.03.2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Trimble Navigation	Electronics & semiconductors	1.29	United States
Deere & Co	Mechanical engineering & industrial equip.	1.16	United States
Veolia Environnement	Energy & water supply	1.15	France
Keysight Technologies	Electrical appliances & components	1.08	United States
Thermo Fisher Scientific	Electronics & semiconductors	1.07	United States
Advanced Micro Devices	Electronics & semiconductors	0.97	United States
GXO Logistics	Traffic & Transportation	0.94	United States
Nvidia	Electronics & semiconductors	0.93	United States
Albemarle	Chemicals	0.91	United States
Amazon.com	Retail trade & department stores	0.91	United States
Zebra Technologies	Electronics & semiconductors	0.84	United States
Microsoft	Internet, software & IT services	0.84	United States
Danaher	Mechanical engineering & industrial equip.	0.83	United States
Uber	Internet, software & IT services	0.83	United States
Darling Ingredients	Energy & water supply	0.82	United States



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 96.2 % (ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale).

Wie sah die Vermögensallokation aus?

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



#1 Nachhaltige Investitionen umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.
#2 Nicht nachhaltige Investitionen umfasst Investitionen, die nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

96.20% der Investitionen des Finanzprodukts wurden getätigt, um ökologische oder soziale Merkmale zu erfüllen (#1 ausgerichtet auf ökologische/soziale Merkmale).

3.80% waren #2 Andere und bestanden aus Barmitteln und Investitionen ohne Rating von MSCI ESG

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Sektor	
Industriegüter	24.42%
Informationstechnologie	20.92%
Gesundheitswesen	12.33%
zyklische Konsumgüter	10.57%
Material	7.38%
Basiskonsumgüter	5.40%
Versorgungsunternehmen	4.67%
Finanzen	4.12%
Kommunikationsdienstleistungen	3.68%
Energie	2.43% (davon 2.43% Erdöl, Erdgas u. nicht erneuerbare Brennstoffe)
Immobilien	1.51%



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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

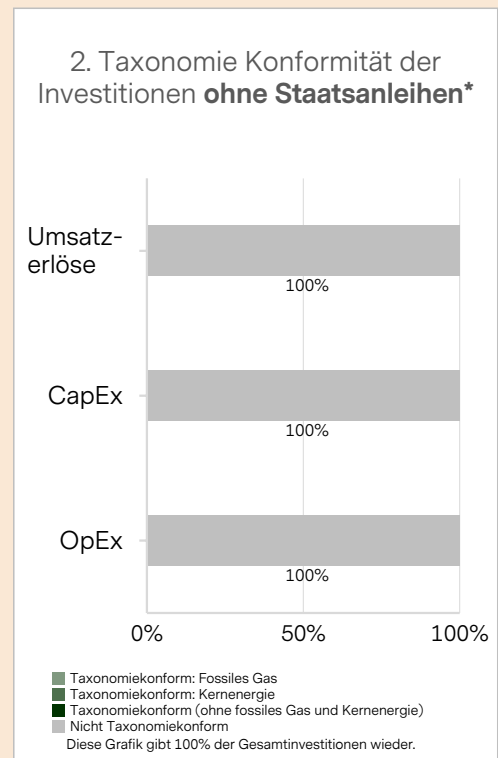
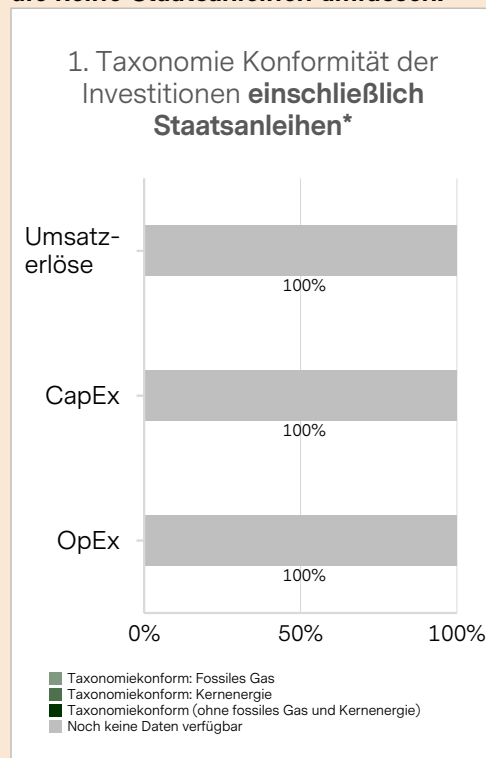
- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

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

- Ja:
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

¹ 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 am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-Taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



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

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

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

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

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

Tätigkeiten	Anteil an Investitionen
Übergangstätigkeiten	0.00%
Ermöglichende Tätigkeiten	0.35%

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

Berichtsdatum	Anteil an Investitionen
N/A	0.00%

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

Anteil an Investitionen
0.00%



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Anteil an Investitionen
0.00%



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

Investitionen	Anlagezweck	Ökologischer oder sozialer Mindestschutz
Investitionen ohne Rating von MSCI ESG (0,90 Prozent)	Diversifizierung	keiner
Barmittel (2.90%)	Liquiditätsmanagement	keiner



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

Die verbindlichen Elemente der Investitionsstrategie, die bei der Auswahl der

Investitionen zur Erreichung der durch diesen Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale verwendet werden, wurden während der gesamten Berichtsperiode überwacht.

In der Berichtsperiode investierte der Teilfonds 1,29 Prozent seines Nettovermögens in Wertpapiere von Unternehmen, die sich auf der Ausnahmeliste des Anlageverwalters befanden.

Eine Ausnahmeliste kann für Unternehmen geführt werden, die die festgelegte Umsatzschwelle im Bereich Kraftwerkskohle und/oder Atomenergie überschreiten. In diese Unternehmen kann investiert werden, wenn sie über eine konkrete Strategie zur Klimawende für die nächsten ein bis drei Jahrzehnte verfügen, z. B. Ziele für die quantitative CO₂-Reduzierung oder zur Erreichung der Klimaneutralität mittels Erhöhung der Investitionsausgaben und der Produktionskapazitäten im Bereich alternative Energien in den kommenden ein bis drei Jahrzehnten, und wenn sie darüber hinaus über eine Strategie für den Ausstieg aus der Kraftwerkskohle und/oder Atomenergie verfügen oder ihr Umsatzanteil in diesen beiden Bereichen rückläufig ist.

Bei diesen beiden Unternehmen handelte es sich um Nextera Energy und RWE. Das Engagement von Nextera Energy im Bereich Atomenergie liegt mit 15,44 Prozent oberhalb der Umsatzschwelle von 10 Prozent. Allerdings ist das Unternehmen auch führend bei der Herstellung von Energie aus erneuerbaren Quellen (Wind- und Solarenergie) und verfolgt das Ziel, bis spätestens 2045 in seinem gesamten Geschäftsbetrieb keinerlei Kohlenstoffemissionen (Scope 1 und Scope 2) mehr zu erzeugen. Das Engagement von RWE im Bereich Kraftwerkskohle liegt mit 17 Prozent oberhalb der Umsatzschwelle von 10 Prozent. Die Ausnahme wird in diesem Fall damit begründet, dass RWE ein führender Anbieter im Bereich der erneuerbaren Energien ist und sich das klare Ziel gesetzt hat, bis 2040 klimaneutral zu werden – gestützt auf Emissionsziele, die von der SBTi bestätigt wurden.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

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

Das Finanzprodukt hat keinen Referenzwert festgelegt, anhand dessen bestimmt werden kann, ob das Finanzprodukt mit den von ihm geförderten ökologischen und/oder sozialen Merkmalen übereinstimmt.