

## ABN AMRO FUNDS

Kurzbezeichnung AAF

Eine offene Investmentgesellschaft nach Luxemburger Recht

# ANFORDERUNG VON INFORMATIONEN

ABN AMRO FUNDS  
49, avenue J.F. Kennedy  
L-1855 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

## HINWEIS

Dieser Prospekt darf nicht für die Zwecke eines Angebots oder einer Aufforderung zum Verkauf in Ländern oder unter Umständen verwendet werden, in denen ein solches Angebot oder eine solche Aufforderung nicht zulässig ist.

Die Gesellschaft ist als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) in Luxemburg zugelassen.

Sie ist insbesondere zur Vermarktung ihrer Anteile in Luxemburg, Belgien, Frankreich, den Niederlanden und Deutschland zugelassen. Nicht unbedingt alle Teilfonds, Anteilskategorien oder Anteilsklassen sind in diesen Ländern registriert. Es ist unerlässlich, dass sich potenzielle Anleger vor der Zeichnung von Anteilen über die Teilfonds, Anteilskategorien oder Anteilsklassen, die in ihrem Wohnsitzland zum Vertrieb zugelassen sind, und die in dem betreffenden Land unter Umständen geltenden spezifischen Beschränkungen informieren.

Unter Berücksichtigung der Bestimmungen der Verordnungen (EU) 833/2014 und 2022/398 ist die Zeichnung von Anteilen von Teilfonds der Gesellschaft ABN AMRO Funds für jeden russischen oder belarussischen Staatsbürger, für jede natürliche Person mit Wohnsitz in Russland oder Belarus oder für jede in Russland oder Belarus errichtete juristische Person, jeden dort errichteten Rechtsträger oder jede dort errichtete Körperschaft mit Ausnahme von Staatsangehörigen eines Mitgliedstaats der Europäischen Union und natürlichen Personen mit einer befristeten oder dauerhaften Aufenthaltserlaubnis in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union untersagt.

Die Anteile wurden und werden nicht nach dem U.S. Securities Act von 1933 registriert oder gemäß geltenden Gesetzen von US-Bundesstaaten qualifiziert und sie dürfen nicht in den Vereinigten Staaten von Amerika (einschließlich deren Territorien und Besitzungen) oder, direkt oder indirekt, an eine oder zu Gunsten einer US-Person (gemäß der Definition in Regulation S des U.S. Securities Act von 1933) übertragen, angeboten oder verkauft werden, sofern nicht zuvor eine Registrierung erfolgt oder eine Befreiung gilt.

Die Gesellschaft ist und wird nicht nach dem Gesetz von 1940 registriert und die Anleger haben keinen Anspruch auf den Vorteil der Registrierung nach dem Gesetz von 1940. Weiterverkäufe und Übertragungen der Anteile in den Vereinigten Staaten oder an US-Personen können eine Verletzung der US-Gesetze darstellen und erfordern die vorherige schriftliche Zustimmung der Gesellschaft. Die Gesellschaft behält sich jedoch das Recht vor, eine Privatplatzierung ihrer Anteile an eine begrenzte Anzahl oder Kategorie von US-Personen vorzunehmen. Weiterverkäufe und Übertragungen der Anteile in den Vereinigten Staaten oder an US-Personen können eine Verletzung der US-Gesetze darstellen und erfordern die vorherige schriftliche Zustimmung des Verwaltungsrats der Gesellschaft. Personen, die Anteile beantragen, müssen schriftlich bestätigen, dass sie keine US-Personen sind.

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft ist ermächtigt, Einschränkungen im Hinblick auf das Halten von Anteilen durch (und folglich die Rücknahme von Anteilen, die gehalten werden von) oder die Übertragung von Anteilen an US-Personen aufzuerlegen. Diese Ermächtigung schließt alle Personen ein, die gegen die Gesetze oder Bestimmungen eines Landes oder einer Behörde zu verstoßen scheinen, oder Personen, bei denen die Umstände (unabhängig davon, ob diese die Personen direkt oder indirekt betreffen oder ob diese Personen einzeln oder zusammen mit einer oder mehreren anderen Personen, ob verbunden oder nicht, zu sehen sind, oder sonstige Umstände, die dem Verwaltungsrat der Gesellschaft als relevant erscheinen) nach Ansicht des Verwaltungsrats der Gesellschaft dazu führen können, dass die Gesellschaft irgendeinen Nachteil erleidet, den sie sonst möglicherweise nicht erlitten hätte.

Die Anteile wurden von der SEC, einer US-bundesstaatlichen Wertpapierkommission oder sonstigen US-Aufsichtsbehörde weder zugelassen noch wurde eine solche Zulassung verweigert. Darüber hinaus hat keine der vorgenannten Aufsichtsbehörden über die Vorteile der Anteile oder die Richtigkeit oder die Angemessenheit dieser Angebotsunterlagen entschieden. Gegensätzliche Darstellungen sind ungesetzlich.

Die Anteilinhaber müssen die Gesellschaft unverzüglich benachrichtigen, wenn sie US-Personen werden. Anteilinhaber, die US-Personen werden, müssen ihre Anteile jederzeit an Nicht-US-Personen verkaufen. Die Gesellschaft behält sich das Recht vor, Anteile, die sich direkt oder indirekt im Besitz einer US-Person befinden oder in deren Besitz übergehen, zurückzukaufen. Dasselbe gilt für den Fall, dass das Halten der Anteile durch eine Person ungesetzlich oder den Interessen der Gesellschaft abträglich ist.

Nach den grundlegenden Bestimmungen von FATCA, der in Luxemburg durch das zwischenstaatliche Abkommen zwischen Luxemburg und den USA umgesetzt und durch das Luxemburger Parlament am 24. Juli 2015 ratifiziert wurde (das „Luxemburger FATCA-Gesetz“), wird die Gesellschaft derzeit offenbar als FFI eingestuft. Um dem zu entsprechen, kann die Gesellschaft von allen ihren Anteilinhabern verlangen, Nachweise über ihre Steueransässigkeit sowie alle sonstigen Informationen vorzulegen, die zur Einhaltung des zuvor genannten Gesetzes als notwendig erachtet werden.

Unbeschadet jeder anderen hierin enthaltenen Bestimmung und sofern es nach den Luxemburger Gesetzen zulässig ist, hat die Gesellschaft das Recht:

- alle Steuern oder vergleichbaren Abgaben einzubehalten, zu deren Einbehaltung sie von Rechts wegen entweder durch Gesetz oder anderweitig im Hinblick auf das Halten von Anteilen an der Gesellschaft verpflichtet ist;
- von jedem Anteilinhaber oder wirtschaftlichem Eigentümer der Anteile die Bereitstellung solcher persönlichen Angaben zu verlangen, die im Ermessen der Gesellschaft zur Einhaltung eines Gesetzes und/oder zur zügigen Bestimmung des einzubehaltenden Betrags erforderlich sein können;
- jede dieser persönlichen Informationen an eine Steuer- oder Aufsichtsbehörde weiterzugeben, wenn dies gesetzlich oder durch eine solche Behörde verlangt wird;
- die Auszahlung von Dividenden oder von Rücknahmeerlösen an einen Anteilinhaber solange einzubehalten, bis der Gesellschaft ausreichende Informationen vorliegen, um den korrekten einzubehaltenden Betrag bestimmen zu können.

Darüber hinaus bestätigt die Gesellschaft hiermit, dass sie ein berichtendes luxemburgisches Finanzinstitut im Sinne des Luxemburger FATCA-Gesetzes ist, und dass sie zu FATCA-Zwecken beim IRS registriert ist, um eine GIIN zu erhalten; ferner handelt die Gesellschaft nur mit professionellen Finanzintermediären, die ordnungsgemäß mit einer GIIN registriert sind.

Zusätzlich darf niemand andere als die im Verkaufsprospekt oder in den darin genannten und öffentlich zugänglichen Dokumenten enthaltenen Informationen veröffentlichen. Der Verwaltungsrat der Gesellschaft bürgt für die Richtigkeit der Angaben im Verkaufsprospekt zum Datum der Veröffentlichung.

Schließlich kann der Verkaufsprospekt jederzeit aktualisiert werden, um der Hinzufügung oder dem Wegfall von Teilfonds sowie jeglichen wesentlichen Änderungen der Struktur und der Arbeitsweise der Gesellschaft Rechnung zu tragen. Daher wird Zeichnern empfohlen, aktuellere Dokumente gemäß den Angaben unten im Abschnitt „Informationen für Anteilinhaber“ anzufordern. Zeichnern wird außerdem empfohlen, sich zu Gesetzen und Vorschriften (z. B. zu Besteuerung und Devisenkontrollen) beraten zu lassen, die für die Zeichnung, den Kauf, den Besitz und die Rücknahme von Anteilen in ihrem Herkunfts-, Aufenthalts- oder Wohnsitzland gelten.

Der Prospekt ist nur in Verbindung mit dem aktuellsten geprüften Jahresbericht sowie dem aktuellsten Zwischenbericht gültig, sofern dieser nach dem Jahresbericht veröffentlicht wurde.

Im Falle von Widersprüchlichkeiten oder Mehrdeutigkeiten bei der Auslegung eines Begriffs oder Satzes in einer Übersetzung des Prospekts ist die englische Fassung maßgeblich.

## INHALT

ALLGEMEINE INFORMATIONEN.....	5
TERMINOLOGIE.....	9
<b>TEIL I DES PROSPEKTS</b> .....	16
Allgemeine Bestimmungen .....	17
Verwaltung.....	18
Anlagepolitik, -ziele, -beschränkungen und -techniken.....	21
Die Anteile.....	23
Nettoinventarwert.....	29
Nettoinventarwert.....	32
Hauptversammlungen und Informationen für Anteilinhaber .....	34
Anhang 1 – Anlagebeschränkungen .....	35
Anhang 2 – Techniken, Finanzinstrumente und Anlagepolitiken.....	39
Anhang 3 – Anlagerisiken.....	48
Anhang 4 – Gemeinsame Verwaltung.....	54
Anhang 5 – Zusammenlegungs-, Schließungs-, Liquidations- und Teilungsverfahren.....	55
<b>TEIL II DES PROSPEKTS SINGLE MANAGER</b> .....	56
ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities.....	57
ABN AMRO Funds Alger US Equities .....	61
ABN AMRO Funds Amundi European Equities.....	62
ABN AMRO Funds Aristotle US Equities.....	66
ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds .....	69
ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds.....	72
ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds.....	75
ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds .....	79
ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities .....	83
ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities.....	86
ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds .....	93
ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds.....	96
ABN AMRO Funds Candriam European ESG Convertibles .....	99
ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities .....	102
ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities .....	105
ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities.....	108
ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles .....	111
ABN AMRO Funds Candriam Global Dividend Equities.....	114
ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds .....	117
ABN AMRO Funds Candriam Total Return Global Bonds.....	120
ABN AMRO Funds Candriam Total Return Global Equities .....	123
ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities.....	126
ABN AMRO Funds Emerging Market ESG Equities .....	129
ABN AMRO Funds Global ESG Equities.....	132
ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities.....	135
ABN AMRO Funds Insight Euro Aggregate Bonds.....	138
ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds.....	141
ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged.....	146
ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds.....	147
ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged.....	150
ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities.....	153
ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities .....	156
ABN AMRO Funds M&G Emerging Market Equities.....	159
ABN AMRO Funds Numeric Emerging Market Equities .....	162
ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities.....	165
ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds.....	170
ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds.....	173
ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities.....	176
ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities .....	179
ABN AMRO Funds Pzena European Equities.....	182
ABN AMRO Funds Pzena US Equities .....	186
ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-related Bonds.....	190
ABN AMRO Funds Sands Emerging Market Equities.....	193
ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds.....	196
ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged.....	199
ABN AMRO Funds Walden US ESG Equities.....	202
ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities .....	203
<b>TEIL II DES PROSPEKTS FUND OF MANDATES</b> .....	206
ABN AMRO Funds Fund of Mandates Pacific Equities .....	207
ABN AMRO Funds Fund of Mandates Emerging Market Equities .....	210
ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds.....	213
ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged.....	216
ABN AMRO Funds Fund of Mandates North American Equities.....	219
ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds .....	222
ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds.....	225
<b>TEIL II DES PROSPEKTS PROFILE</b> .....	228
ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive.....	229
ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive .....	232
ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderatly Defensive .....	235
ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderatly Aggressive .....	238

ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive.....	242
ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive .....	245
ABN AMRO Funds Comfort Invest II .....	248
ABN AMRO Funds Comfort Invest III .....	251
ABN AMRO Funds Comfort Invest IV.....	254
ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Defensief .....	257
ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Defensief.....	259
ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Defensief.....	262
ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Offensief .....	265
ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Offensief .....	268
ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Offensief .....	271
ABN AMRO Funds Global Balanced .....	274
ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities.....	280
ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities .....	283
ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds .....	286
ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds .....	289
Anhang 1 - Offenlegungsverordnung und Taxonomie .....	292
Anhang 2 - Vorvertragliche Anhänge in Übereinstimmung mit der EU-Verordnung 2022/1288.....	294

Für jeden einzelnen Teilfonds ist ein Informationsabschnitt verfügbar. Er gibt für jeden Teilfonds die Anlagepolitik und das Anlageziel, die Merkmale der Anteile, ihre Rechnungswährung, den Bewertungstag, die Zeichnungs-, Rücknahme- und/oder Umtauschmodalitäten, die anfallenden Gebühren sowie gegebenenfalls historische Daten und andere Besonderheiten des betreffenden Teilfonds an. Anleger werden darauf hingewiesen, dass für jeden Teilfonds, soweit in Teil II nichts anderes angegeben ist, die in Teil I festgelegten allgemeinen Bestimmungen gelten.

---

## ALLGEMEINE INFORMATIONEN

---

### EINGETRAGENER SITZ

ABN AMRO Funds  
49, avenue J.F. Kennedy  
L-1855 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

### VERWALTUNGSRAT DER GESELLSCHAFT

#### Vorsitzender

François Xavier GENNETAIS, Chief Executive Officer, ABN AMRO Investment Solutions, Paris

#### Mitglieder

Adriaan KOOTSTRA, Head Global Fund Center, ABN AMRO Private Banking  
Frau Axelle FERREY, Stabschefin des CEO – COO, DLA Piper  
Elisa ALONSO SANZ, Chief Operating Officer und Vorstandsmitglied von ABN AMRO Investment Solutions, Paris  
Olivier LEGUAY, Chief Administrative Officer, ABN AMRO Investment Solutions, Paris  
Herr Werner WEYNAND, unabhängiges Verwaltungsratsmitglied

#### Managing Director

François Xavier GENNETAIS, Chief Executive Officer, ABN AMRO Investment Solutions, Paris

### VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

ABN AMRO Investment Solutions  
119-121, Bd Haussmann  
F-75008 Paris  
Frankreich

ABN AMRO Investment Solutions ist eine nach französischem Recht gegründete Gesellschaft, die bei der AMF als eine „*Société de Gestion de Portefeuille*“ von OGAW registriert und von der CSSF für Tätigkeiten der gemeinsamen Portfolioverwaltung für OGAW in Luxemburg im Rahmen der Dienstleistungsfreiheit gemäß den Bestimmungen der Richtlinie 2009/65 zugelassen ist.

ABN AMRO Investment Solutions erfüllt in ihrer Eigenschaft als Verwaltungsgesellschaft (die „**Verwaltungsgesellschaft**“) der ABN AMRO Funds die Aufgaben der Verwaltung, der Portfolioverwaltung und der Vermarktung.

ABN AMRO Investment Solutions ist eine Anlageverwaltungsgesellschaft der ABN AMRO Gruppe. ABN AMRO Investment Solutions ist eine hundertprozentige Tochtergesellschaft der ABN AMRO Bank NV.

### VERWALTUNGSRAT DER VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

#### Vorsitzender

François Xavier GENNETAIS, Chief Executive Officer, ABN AMRO Investment Solutions, Paris

#### Mitglieder

Christophe BOUCHER, Chief Investment Officer, ABN AMRO Investment Solutions, Paris  
Elisa Alonso-Sanz, Chief Operations Officer, ABN AMRO Investment Solutions, Paris

### NIW-BERECHNUNG

STATE STREET BANK INTERNATIONAL GMBH, NIEDERLASSUNG LUXEMBURG  
49, avenue J.F. Kennedy  
L-1855 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

### TRANSFER- UND REGISTERSTELLE

STATE STREET BANK INTERNATIONAL GMBH, NIEDERLASSUNG LUXEMBURG  
49, avenue J.F. Kennedy  
L-1855 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

### VERWAHRSTELLE / ZAHLSTELLE

STATE STREET BANK INTERNATIONAL GMBH, NIEDERLASSUNG LUXEMBURG  
49, avenue J.F. Kennedy  
L-1855 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

## ANLAGEVERWALTER

ABN AMRO Investment Solutions wurde vom Verwaltungsrat zur Verwaltungsgesellschaft ernannt und ist als solche für die Anlageverwaltung jedes Teilfonds der Gesellschaft verantwortlich.

In ihrer Eigenschaft als Verwaltungsgesellschaft kann ABN AMRO Investment Solutions die Aufgaben der Portfolioverwaltung insbesondere der Teilfonds „Fund of Mandates“, „Single Manager“, „Profile“ und „Index“ (ganz oder teilweise) an die folgenden externen Anlageverwalter übertragen:

- Alliance Bernstein L.P.  
501 Commerce Street, Nashville, Tennessee 37203, Vereinigte Staaten von Amerika  
Eine im Januar 1971 gegründete Gesellschaft nach amerikanischem Recht
- Amundi Asset Management SAS  
90 boulevard Pasteur, F-75015 Paris, Frankreich  
Eine Gesellschaft nach französischem Recht
- Amundi Ireland Limited  
1 George's Quay Plaza's, George's Quay, Dublin 2, Irland  
Eine Gesellschaft nach irischem Recht, Mitglied der Amundi Gruppe
- Aristotle Capital Management, LLC  
11100 Santa Monica Boulevard Suite 1700, Los Angeles, CA 90025, Vereinigte Staaten von Amerika  
Eine 2006 gegründete Gesellschaft nach amerikanischem Recht
- Barings LLC  
300 South Tryon Street, suite 2500, Charlotte, NC 28202, Vereinigte Staaten von Amerika  
Eine Gesellschaft nach amerikanischem Recht
- Baring Asset Management Limited  
20 Old Bailey, London EC4M 7BF, Vereinigtes Königreich  
Eine Gesellschaft nach britischem Recht
- BlackRock Investment Management (UK) Ltd  
12 Throgmorton Avenue, London EC2N 2DL, Vereinigtes Königreich  
Eine 1988 gegründete Gesellschaft nach britischem Recht, Mitglied der BlackRock Gruppe
- Boston Common Asset Management, LLC  
200 State Street, 7th Floor, Boston, MA 02109, Vereinigte Staaten von Amerika  
Eine Gesellschaft nach amerikanischem Recht
- Boston Trust Walden Inc.  
1 Beacon Street, Boston MA 02108-3116, Vereinigte Staaten von Amerika  
Eine 1974 gegründete Gesellschaft nach amerikanischem Recht
- Candriam  
19-21, route d'Arlon, 8009 Strassen, Großherzogtum Luxemburg  
Eine nach luxemburgischem und britischem Recht am 08.08.1991 gegründete Gesellschaft, Mitglied der Candriam Group, die nach Genehmigung durch die Verwaltungsgesellschaft ihre Portfoliomanagementaufgaben an folgende Gesellschaft delegiert:  
Candriam UK,  
200 Aldersgate St, Barbican, London EC1A 4HD, Vereinigtes Königreich  
Fällt als britische Niederlassung unter die Regelung der luxemburgischen Gesellschaft, die am 08.05.2012 gegründet wurde und zur Candriam Group gehört
- EdenTree Investment Management Limited  
Benefact House, 2000 Pioneer Avenue, Gloucester Business Park, Brockworth, Gloucester, Vereinigtes Königreich, GL3 4AW  
Eine Gesellschaft mit beschränkter Haftung nach dem Recht von England und Wales
- Goldman Sachs Asset Management International  
Plumtree Court, 25 Shoe Lane, London, EC4A 4AU, Vereinigtes Königreich  
Eine Gesellschaft nach britischem Recht
- Impax Asset Management, LLC  
30 Penhallow Street, Suite 400, Portsmouth, NH 03801, Vereinigte Staaten von Amerika  
Eine Gesellschaft nach amerikanischem Recht.
- Insight Investment Management (Global) Limited  
160 Queen Victoria Street, EC4V 4LA, London, Vereinigtes Königreich  
Eine Gesellschaft nach britischem Recht, Mitglied der BNY Mellon Gruppe
- J.P. Morgan Asset Management (Europe) S.à r.l  
6, route de Trèves, Senningerberg, L-2633 Luxemburg  
Eine Gesellschaft nach luxemburgischem Recht
- Kempen Capital Management N.V.  
Beethovenstraat 300 – 1077 WZ Amsterdam, Niederlande  
Eine Gesellschaft nach niederländischem Recht
- Liontrust Investment Partners LLP  
2 Savoy Court, London, WC2R 0EZ, Vereinigtes Königreich  
Eine Gesellschaft nach britischem Recht
- M&G Investment Management Limited  
10 Fenchurch Avenue, London EC3M 5AG, Vereinigtes Königreich  
Eine Gesellschaft nach britischem Recht
- NN Investment Partners B.V.  
Schenkade 65, 2595 AS, Den Haag, Niederlande  
Eine Gesellschaft nach niederländischem Recht

- Numeric Investors LLC  
200 Pier Four Boulevard, Boston MA 02210, Vereinigte Staaten von Amerika  
Eine Gesellschaft nach amerikanischem Recht
- Parnassus Investments  
1, Market Street, Suite 1600, San Francisco, CA 94105, USA  
Eine Gesellschaft nach amerikanischem Recht
- PGIM Inc.  
655 Broad Street, Newark, NJ 07102, USA  
Eine Gesellschaft nach amerikanischem Recht
- Principal Global Investors, LLC  
801 Grand Avenue, Des Moines, Iowa 50392, Vereinigte Staaten von Amerika  
Eine im Oktober 1998 gegründete Gesellschaft nach amerikanischem Recht, Tochtergesellschaft der Principal Financial Gruppe
- Pzena Investment Management, LLC  
320 Park Avenue, New York, N.Y. 10022, Vereinigte Staaten von Amerika  
Eine Gesellschaft nach amerikanischem Recht, gegründet am 27. November 1995
- RBC Global Asset Management (UK) Limited  
77 Grosvenor Street, London, W1K 3JR, Vereinigtes Königreich  
Eine Gesellschaft nach britischem Recht
- Robeco Institutional Asset Management B.V.  
Coolingel 120, 3011 AG- Rotterdam, Niederlande  
Eine 1929 gegründete Gesellschaft nach niederländischem Recht
- Sands Capital Management, LLC  
1000 Wilson Boulevard, Suite 3000, Arlington, Virginia 22209, Vereinigte Staaten von Amerika  
Eine Gesellschaft nach amerikanischem Recht
- Schroder Investment Management Ltd  
1 London Wall Place, London EC2Y 5AUAU, Vereinigte Staaten von Amerika  
Eine 2001 gegründete Gesellschaft nach britischem Recht
- The Putnam Advisory Company, LLC  
100 Federal Street, Boston, Massachusetts 02110, Vereinigte Staaten von Amerika  
Eine im Dezember 2000 gegründete Gesellschaft nach amerikanischem Recht
- Walter Scott & Partners Limited  
1 Charlotte Square Edinburgh, EH2 4DR, Vereinigtes Königreich  
Eine 1983 gegründete Gesellschaft nach schottischem Recht  
Anleger können eine aktualisierte Liste der Anlageverwalter anfordern, wie im Abschnitt „Verwaltung“ des Prospekts beschrieben.

## **BERATER**

- ABN AMRO Bank N.V. Niederlassung Belgien  
Borsbeeksebrug 30, 2600 Berchem, Belgien  
Eine Gesellschaft nach belgischem Recht
- ABN AMRO Bank N.V.  
Gustav Mahlerlaan 10, 1082 PP Amsterdam, Niederlande  
Eine Gesellschaft nach niederländischem Recht

## **ABSCHLUSSPRÜFER**

- PricewaterhouseCoopers, Société coopérative  
2, rue Gerhard Mercator, B.P. 1443, L-1014 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

## **VERTRETUNGEN**

### ***In Belgien***

- CACEIS Belgium S.A., Avenue du Port 86 C b320, B-1000 Brüssel (*Finanzbeauftragter*)

### ***In Frankreich***

- CACEIS Bank France, 89-91 rue Gabriel Péri, F-92120 Montrouge (*Zahlstelle*)

### ***In Deutschland***

- State Street Bank GmbH, Agent Fund Trading, Solmsstraße 83, 60486 Frankfurt (*Zahl- und Informationsstelle*)

### ***in Österreich***

- Société Générale Vienna Branch, Prinz-Eugen-Straße 8-10/5/TOP 11, A-1040 Wien, Österreich (*Zahl- und Informationsstelle*)

### ***In der Schweiz***

- CACEIS Bank, Montrouge, succursale de Nyon, 35 Route de Signy, CH-1260 Nyon, Schweiz (*Zahlstelle*)
- CACEIS (Switzerland) SA, 35 Route de Signy, CH-1260 Nyon, Schweiz (*Vertreter*)

### ***Im Vereinigten Königreich***

- Société Générale Securities Services, SG House, 41 Tower Hill, London EC3N 4SG, Vereinigtes Königreich (*Facility-Agent*)

### ***in Italien***

- Allfunds Bank S.A.U. – Succursale di Milano, Via Bocchetto 6, 20123 Mailand, Italien (*Zahlstelle*)

### ***In Dänemark***

- Skandinaviska Enskilda Banken, Bernstorffsgade 50, 1577 Kopenhagen V, Dänemark (*Zahlstelle*)

### **In Schweden**

- Skandinaviska Enskilda Banken, Kungsträdgårdsgatan 8, SE-106 40 Stockholm, Schweden (Zahlstelle)

### **SATZUNG**

Die Gesellschaft wurde am 17. November 2000 gegründet. Eine entsprechende Meldung wurde im *Mémorial, Recueil Spécial des Sociétés et Associations* (das „*Mémorial*“) veröffentlicht.

Die Satzung der Gesellschaft (die „**Satzung**“) wurde mehrfach geändert, zum letzten Mal durch die am 30. Juli 2021 abgehaltene außerordentliche Hauptversammlung.

Die aktuelle Version der Satzung wurde im *Recueil Electronique des Sociétés et Associations* von Luxemburg (Luxemburger Handels- und Gesellschaftsregister) hinterlegt, wo alle Interessierten sie einsehen und ein Exemplar erhalten können (Webseite [www.rcs.lu](http://www.rcs.lu)).



---

## TERMINOLOGIE

---

Für die Zwecke dieses Dokuments haben die nachfolgenden Begriffe die nachfolgenden Bedeutungen. Die nachstehende Terminologie ist eine allgemeine Liste von Begriffen. Es ist daher möglich, dass nicht alle von ihnen im vorliegenden Dokument verwendet werden.

<b><u>AAF:</u></b>	Kurzbezeichnung für ABN AMRO Funds
<b><u>Absolute Return-Anlagen:</u></b>	Eine Anlageform, die auf die Erzielung positiver Renditen ausgerichtet ist. Zu diesem Zweck werden Anlageverwaltungstechniken eingesetzt, die sich—von denen herkömmlicher Investmentfonds unterscheiden, wie beispielsweise Leerverkäufe, Termingeschäfte, Optionen, Derivate, Arbitrage- und Hebelstrategien.
<b><u>ABS/MBS:</u></b>	Asset-Backed Securities/Mortgage-Backed Securities
<b><u>Rechnungswährung:</u></b>	Währung, in der die Vermögenswerte eines Teilfonds buchhalterisch ausgedrückt werden, und die sich von der Bewertungswährung der Anteilskategorie unterscheiden kann.
<b><u>Aktives Trading:</u></b>	Die Zeichnung, der Umtausch oder die Rücknahme innerhalb eines Teilfonds in einem kurzen Zeitraum und in bedeutender Höhe, normalerweise mit dem Ziel, einen kurzfristigen Gewinn zu erzielen. Dieses Vorgehen ist für die anderen Anteilhaber von Nachteil, weil es die Wertentwicklung des Teilfonds beeinträchtigt und die Vermögensverwaltung stört.
<b><u>ADR:</u></b>	American Depositary Receipts
<b><u>Alternative Investments:</u></b>	Anlagen außerhalb der traditionellen Anlageklassen Aktien, Schuldtitel und Barmittel: Sie umfassen Hedgefonds, verwaltete Futures, Immobilienanlagen, Rohstoffanlagen, inflationsgebundene Produkte und Derivatekontrakte. Alternative Investments können die folgenden Strategien verfolgen: Long/Short Equity, Market Neutral Equity, Convertible Arbitrage, Fixed-Income-Arbitrage (Zinsstrukturkurven- oder Corporate-Spread-Arbitrage) Global Macro, notleidende Wertpapiere, Multi-Strategie, verwaltete Futures, Ausnutzen von Kursunterschieden bei Unternehmensübernahmen bzw. -zusammenschlüssen (Take-Over/Merger Arbitrage), Volatilitätsarbitrage, Gesamttrendite
<b><u>AMF:</u></b>	<i>Autorité des Marchés Financiers</i> , die französische Aufsichtsbehörde
<b><u>Zugelassene Anleger:</u></b>	Vom Verwaltungsrat der Gesellschaft speziell zugelassene Anleger
<b><u>Grundlegende Schutzmaßnahmen im Hinblick auf Umwelt und Soziales:</u></b>	Dieses von der Offenlegungsverordnung eingeführte Konzept richtet sich an Investmentfonds, die ESG-Merkmale und/oder -Ziele in ihr Anlageverfahren einbeziehen; die Idee ist, die grundlegenden Schutzmaßnahmen im Hinblick auf Umwelt und Soziales (E/S) zu berücksichtigen (einzuhalten oder zu erklären), wenn es um Anlagen in den schlechtesten Praktiken in den Bereichen Umwelt, Soziales, Menschenrechte und Unternehmensführung geht. Alle Teilfonds, die nicht unter Artikel 8 oder Artikel 9 der Offenlegungsverordnung fallen, müssen die von der Verwaltungsgesellschaft festgelegten Mindestausschlüsse einhalten. Die Liste (in der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft als Satz 1 bezeichnet) wird von der Verwaltungsgesellschaft regelmäßig aktualisiert und an den beauftragten Anlageportfolioverwalter weitergegeben. Die Liste besteht aus Aktivitäten, Unternehmen und Ländern, die als stark umstritten gelten (Tabakproduzenten, Unternehmen, die dem UN Global Compact nicht entsprechen, Länder, die unter einem Embargo stehen).
<b><u>Benchmark-Index:</u></b>	Ein Benchmark-Index, der einen Bezugspunkt für die Bewertung der Wertentwicklung des Teilfonds gibt
<b><u>Referenzwerte-Verordnung</u></b>	Verordnung (EU) 2016/1011 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 8. Juni 2016 über Indizes, die bei Finanzinstrumenten und Finanzkontrakten als Referenzwert oder zur Messung der Wertentwicklung eines Investmentfonds verwendet werden.
<b><u>Verwaltungsrat:</u></b>	Der Verwaltungsrat der Gesellschaft
<b><u>CDO:</u></b>	Collateralized Debt Obligation
<b><u>CDS:</u></b>	Credit Default Swap(s)
<b><u>Rundschreiben 08/356:</u></b>	Von der CSSF am 4. Juni 2008 veröffentlichtes Rundschreiben zu den Regeln, die auf Organismen für gemeinsame Anlagen anwendbar sind, wenn diese bestimmte Techniken und Instrumente einsetzen, die auf übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten basieren. Dieses Dokument ist auf der Webseite der CSSF verfügbar ( <a href="http://www.cssf.lu">www.cssf.lu</a> )
<b><u>Rundschreiben 11/512:</u></b>	Von der CSSF am 30. Mai 2011 veröffentlichtes Rundschreiben über: a) die Darstellung der wichtigsten Änderungen des Rechtsrahmens im Bereich des Risikomanagements nach der Veröffentlichung der CSSF-Verordnung 10-4 und Erläuterungen der ESMA; b) zusätzliche Erläuterungen der CSSF hinsichtlich der Regeln für das Risikomanagement; c) die Definition des Inhalts und der Form des der CSSF anzuzeigenden Risikomanagementverfahrens Dieses Dokument ist auf der Webseite der CSSF verfügbar ( <a href="http://www.cssf.lu">www.cssf.lu</a> )
<b><u>ChinaClear:</u></b>	China Securities Depository and Clearing Corporation Limited
<b><u>Rohstoffanlagen:</u></b>	Anlagen in Instrumenten, die auf Rohstoffen basieren
<b><u>Name der Gesellschaft:</u></b>	ABN AMRO Funds
<b><u>CSRC:</u></b>	China Securities Regulatory Commission
<b><u>CSSF:</u></b>	<i>Commission de Surveillance du Secteur Financier</i> , die Aufsichtsbehörde für OGA im Großherzogtum Luxemburg
<b><u>Währungen:</u></b>	<b><u>EUR:</u></b> Euro <b><u>USD:</u></b> US-Dollar <b><u>SEK:</u></b> Britisches Pfund <b><u>GBP:</u></b> Schwedische Krone  Oder andere Währungen, die der Manager von Zeit zu Zeit hinzufügen kann
<b><u>Datenschutzgesetz:</u></b>	Verordnung (EU) 2016/679 vom 27. April 2016 zum Schutz natürlicher Personen bei der Verarbeitung personenbezogener Daten und zum freien Datenverkehr
<b><u>Entwickelte Märkte:</u></b>	Länder, die zu dem von MSCI Inc. bestimmten Universum der entwickelten Märkte gehören
<b><u>Richtlinie 78/660:</u></b>	Richtlinie 78/660/EWG des Europäischen Rates vom 25. Juli 1978 über den Jahresabschluss von Gesellschaften bestimmter Rechtsformen in der jeweils gültigen Fassung

<b><u>Richtlinie 83/349:</u></b>	Richtlinie 83/349/EWG des Europäischen Rates vom 13. Juni 1983 zu Konzernabschlüssen in der jeweils gültigen Fassung
<b><u>Richtlinie 2003/48:</u></b>	Richtlinie 2003/48/EG des Europäischen Rates vom 3. Juni 2003 im Bereich der Besteuerung von Zinserträgen
<b><u>Richtlinie 2004/39:</u></b>	Richtlinie 2004/39/EWG des Europäischen Rates vom 21. April 2004 über Märkte für Finanzinstrumente
<b><u>Richtlinie 2009/65:</u></b>	Richtlinie 2009/65/EG des Europäischen Rates vom 13. Juli 2009 zur Koordinierung der Rechts- und Verwaltungsvorschriften betreffend bestimmte Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) in der durch die Richtlinie 2014/91/EU geänderten Fassung
<b><u>Notleidende Vermögenswerte:</u></b>	Anleihepapiere, die von Standard & Poor's mit einem Rating unterhalb von „CCC“ und besser als „D“ bzw. von einer anderen Ratingagentur mit einem vergleichbaren Rating bewertet wurden.
<b><u>DNSH</u></b>	Der „Do Not Significantly Harm“-Grundsatz („DNSH“) gemäß der Offenlegungsverordnung findet auf Produkte nach „Art.9“ – Produkte, die eine nachhaltige Investition anstreben, Anwendung. Das Anlageprodukt sollte keine anderen ökologischen oder sozialen Ziele wesentlich beeinträchtigen, die Auswirkungen sollten also messbar und die Endwirkung mindestens neutral und insgesamt positiv sein.
<b><u>DPM:</u></b>	Diskretionäres Portfoliomanagement
<b><u>EDS:</u></b>	Equity Default Swap(s)
<b><u>EWR:</u></b>	Europäischer Wirtschaftsraum
<b><u>Schwellenmärkte:</u></b>	Länder, die zu dem von MSCI Inc. bestimmten Schwellen- und Grenzmarkt-Universum gehören
<b><u>Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG):</u></b>	

<b>Umwelt</b>	Problematiken im Zusammenhang mit der Qualität und dem Funktionieren der Umwelt und der Ökosysteme. Dazu gehören beispielsweise: Verlust der Biodiversität, Treibhausgasemissionen, Klimawandel, erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Luftverschmutzung, Wasser- oder Ressourcenverknappung oder -verschmutzung, Abfallwirtschaft, Schwund der Ozonschicht, Änderung der Landnutzung, Versauerung der Ozeane.
<b>Soziales</b>	Problematiken im Zusammenhang mit den Rechten, dem Wohlergehen und den Interessen von Menschen bzw. Bevölkerungsgruppen. Darunter fallen beispielsweise: Menschenrechtsverletzungen, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Kinderrechtsverletzungen, Sklaven- und Zwangsarbeit, Arbeitsschutz, Vereinigungsfreiheit und Meinungsfreiheit, Personalverwaltung und Arbeitnehmerbeziehungen, Geschlechterdiversität, Beziehungen zu lokalen Gemeinschaften, Aktivitäten in Konfliktgebieten, Gesundheit und Zugang zu Medikamenten, Verbraucherschutz.
<b>Unternehmensführung</b>	Problematiken im Zusammenhang mit der Leitung von Unternehmen und anderen Beteiligungsgesellschaften. Im Rahmen von börsennotierten Unternehmen fallen darunter beispielsweise: Struktur der Leitungsorgane, Größe, Geschlechterdiversität, Fähigkeiten und Unabhängigkeit der Leitungsorgane, Vergütung von Führungskräften, Aktionärsrechte, Interaktion mit Interessengruppen, Offenlegung von Informationen, Geschäftsethik, Bestechung und Korruption, interne Kontrollen und Risikomanagementprozesse sowie im Allgemeinen Aspekte der Beziehung zwischen dem Management eines Unternehmens, seinen Leitungsorganen, seinen Aktionären und seinen Interessengruppen. Diese Kategorie kann auch Aspekte der Geschäftsstrategie umfassen, die sowohl die Auswirkungen der Geschäftsstrategie auf Umwelt- und Sozialfragen als auch die Art und Weise, wie die Strategie umzusetzen ist, umfassen. Bei nicht börsennotierten Unternehmen können Aspekte der Unternehmensführung auch Aspekte der Fondsverwaltung umfassen, z. B. die Befugnisse von Beratungsausschüssen, Bewertungsfragen, Gebührenstrukturen usw.

**ESG-Datenanbieter der Verwaltungsgesellschaft**

**Sustainalytics**

Die Verwaltungsgesellschaft hat Überwachungstools entwickelt, die die von Sustainalytics bereitgestellten ESG-Daten integrieren.

Sustainalytics ist eine hauptsächlich in Europa und Nordamerika tätige Ratingagentur für Nachhaltigkeit, die quantitative und qualitative nicht-finanzielle Informationen über Unternehmen, Staaten und öffentliche Institutionen auf der ganzen Welt bereitstellt.

Sustainalytics liefert ESG-Risiko-Scores basierend auf einer eigenen Analyse der wichtigsten ESG-Themen und der zugrunde liegenden Unterkriterien.

ESG-Risikoansatz auf Unternehmensebene (Anlage in „Unternehmensanleihen“):

Dieser ESG-Risikoansatz unterscheidet zwischen steuerbaren ESG-Risiken (gesteuerte Risiken und Defizite bei der Steuerung) und nicht steuerbaren ESG-Risiken. Das ESG-Risiko-Rating setzt sich aus nicht gesteuerten ESG-Risiken zusammen, die als Defizite (Defizite bei der Steuerung im Vergleich zu Vergleichsgruppen-Standards) und/oder nicht steuerbare Risiken (wie z. B. aufgrund der Spezifität des Geschäfts oder des Regulierungsdrucks) identifiziert wurden.

Durch diese Aufspaltung des Risikos wird das Ratingergebnis hinsichtlich der ESG-Wesentlichkeit (einschließlich einer zukunftsorientierten Dimension) sehr viel realistischer und aussagekräftiger.

Die wesentlichen ESG-Aspekte (Material ESG Issues, „MEI“), die dem ESG-Risiko-Rating zugrunde liegen, sind nach den folgenden Themen gruppiert: Unternehmensführung, Zugang zu grundlegenden Dienstleistungen, Bestechung und Korruption, Geschäftsethik, Community Relations, Datenschutz und Datensicherheit, Emissionen, Abwässer und Abfallemissionen, CO<sub>2</sub>-Ausstoß beim Betrieb, CO<sub>2</sub>-Ausstoß im Rahmen von Produkten und Dienstleistungen, Auswirkungen von Produkten und Dienstleistungen auf Umwelt und Soziales, Menschenrechte (Mitarbeiter, Lieferkette), Humankapital, Landnutzung und Biodiversität (Betrieb und Lieferkette), Gesundheit und Sicherheit, ESG-Integration im Finanzbereich, Produktüberwachung, Belastbarkeit und Ressourcenverbrauch (im Unternehmen, Lieferkette).

ESG-Risikoansatz auf Länderebene („Anlagen in Staatsanleihen“):

Das Länderrisiko-Rating misst das Risiko für den langfristigen Wohlstand und die wirtschaftliche Entwicklung eines Landes, indem es den nationalen Reichtum eines Landes und die Fähigkeit bewertet, diesen Reichtum effektiv und nachhaltig zu nutzen und zu verwalten.

Das Rating misst den nationalen Reichtum, der sich aus natürlichem und produziertem Kapital, Humankapital und institutionellem Kapital zusammensetzt, sowie der Fähigkeit eines Landes, dieses Kapital auf effektive und nachhaltige Weise zu nutzen und zu verwalten, bestimmt durch seine ESG-Performance, ESG-Trends und ESG-Ereignisse. Der zusammengesetzte Score beinhaltet einen Vermögens-Score und einen ESG-Risikofaktor-Score, der diesen beiden Komponenten entspricht.

Die wichtigsten Aspekte, die dem Länderrating zugrunde liegen, sind in den folgenden Faktoren zugeordnet: Energie und Klimawandel, Ressourcennutzung, Unternehmensführung, Grundbedürfnisse, Gesundheit und Wohlbefinden, Gleichheit und Chancen, institutionelle Stärke, Rechte und Freiheiten, Frieden und Sicherheit.

Umfang: Die Bewertung geht von 0 bis 100 und unterscheidet fünf Risikostufen: vernachlässigbar (<10), gering (von 10 bis 20), mittel (von 20 bis 30), hoch (von 30 bis 40) und schwerwiegend (>40). Beachten Sie: je niedriger das ESG-Risiko-Rating, desto geringer ist das ESG-Risiko und desto besser würde der Emittent in Zukunft mit Nachhaltigkeitsthemen umgehen (und somit ist die erwartete Auswirkung von Nachhaltigkeitsrisiken auf den Unternehmenswert geringer).

#### Kontroversen

Eine Kontroverse geht aus einem Ereignis hervor und führt zu negativen ESG-Auswirkungen auf das Unternehmen. Kontroversen spielen beim ESG-Risiko-Rating eine wichtige Rolle und ermöglichen es, das Rating zwischen den Rating-Aktualisierungen aufgrund von Offenlegungen besser an neue Informationen anzupassen. Sustainalytics bewertet die Kontroversen nach relevanten Themen auf einer Saffir-Simpson-Hurrikanskala von 0 (keine) bis 5 (schwerwiegend).

Die Verwaltungsgesellschaft ist bestrebt, schwerwiegende Kontroversen in ihren Portfolios zu vermeiden, da wir ihren Ruf schützen und etwaige negative finanzielle Auswirkungen aufgrund von ESG-Risiken vermeiden wollen. Die umgesetzten Ausschlussbestimmungen sollten die Portfolios der Verwaltungsgesellschaft vor diesem Risiko schützen.

Die folgenden von Sustainalytics zur Verfügung gestellten Tools werden vom Analystenteam der Verwaltungsgesellschaft vorwiegend genutzt, um quantitative und qualitative Daten des Emittenten sowie globalere Analysen zu den Themen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung einzusehen und zu laden:

- das „Company Research“-Tool, das den Zugang zu den Analyse-Sheets der einzelnen von Sustainalytics untersuchten Emittenten ermöglicht;
- das „Portfolio“-Tool, mit dem Modellportfolios analysiert werden können;
- das „Screening“-Tool, um Sortierungskriterien festzulegen (nach Tätigkeitsbereich und Schwellenwert);
- das „Reporting“-Tool, mit dem Excel- oder CSV-Dateien erzeugt werden können, die direkt mit internen Tools integriert werden können; oder
- das „Knowledge Center“-Tool für Informationen über die letzten Aktualisierungen und Entwicklungen zu den Themen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung.

Die Verwaltungsgesellschaft hat mehrere Kontrollsysteme eingerichtet, um sicherzustellen, dass die nachhaltige Anlagepolitik des Fondsmanagers jedes Teilfonds den ESG-Scores entspricht.

#### ISS

Die 1985 gegründete Unternehmensgruppe Institutional Shareholder Services („ISS“) unterstützt Anleger und Unternehmen dabei, langfristiges und nachhaltiges Wachstum zu erzielen, indem sie hochwertige Daten, Analysen und Erkenntnisse bereitstellt. Mit fast 2.000 Mitarbeitern an 30 US-amerikanischen und internationalen Standorten ist ISS heute der weltweit führende Anbieter von Lösungen für Unternehmensführung und verantwortungsvolles Investieren, Market Intelligence und Fondsdienstleistungen sowie von Veranstaltungen und redaktionellen Inhalten für institutionelle Anleger und Unternehmen auf der ganzen Welt.

Die Verwaltungsgesellschaft hat Überwachungstools entwickelt, die die Ergebnisse des von ISS-Oekom im Rahmen der Bewertung von Nachhaltigkeitslösungen vergebenen „SDG-Gesamt-Scores“ berücksichtigen. Anhand dieser Scores werden die positiven und negativen Auswirkungen der Produkte und Dienstleistungen eines Unternehmens auf verschiedene Nachhaltigkeitslösungen gemessen. Die Verwaltungsgesellschaft verfolgt einen thematischen Ansatz, der 15 verschiedene Nachhaltigkeitsziele umfasst und die Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDG) der Vereinten Nationen (UN) als Referenzrahmen nutzt. Der Gesamt-Score zu SDG-Lösungen geht von -10,0 bis +10,0, wobei der Score in fünf große Bewertungskategorien wie folgt aufgeteilt ist:



Je höher der Score, desto höher ist die Auswirkung. Negative Scores entsprechen einer negativen Auswirkung. Der Nettoauswirkungs-Score umfasst negative und positive Auswirkungs-Scores. Der Nettoauswirkungs-Score kann neutral sein. Teilfonds, die darauf abzielen, einen positiven Beitrag zu den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung zu leisten, sollten auch negative Auswirkungen in Bezug auf die DNSH- und PAI-Grundsätze berücksichtigen.

Die Liste der von der Verwaltungsgesellschaft genutzten ESG-Datenanbieter kann sich in Zukunft ändern, wenn aufgrund von Vorschriften zusätzliche ESG-Daten erforderlich werden. Die Methodik kann auch auf weitere ESG-Themen ausgeweitet werden. Die aktuellen Entwicklungen werden in der nachhaltigen Anlagepolitik auf der Website der Verwaltungsgesellschaft veröffentlicht. Wir weisen darauf hin, dass die von beauftragten Portfolioverwalter andere Quellen und Methoden verwenden können.

<b><u>ESMA:</u></b>	Europäische Wertpapieraufsichtsbehörde (European Securities and Markets Authority)
<b><u>ESMA/2012/197:</u></b>	Von der ESMA am 23. März 2012 herausgegebene Leitlinien für zuständige Behörden und OGAW-Verwaltungsgesellschaften zur Risikomessung und zur Berechnung des Gesamtrisikos für bestimmte Arten strukturierter OGAW. Dieses Dokument ist auf der Webseite der ESMA verfügbar ( <a href="http://www.esma.europa.eu">www.esma.europa.eu</a> ).
<b><u>Externer Anlageverwalter:</u></b>	Der Anlageverwalter, der nicht zur ABN AMRO Gruppe gehört
<b><u>FATCA:</u></b>	U.S. Foreign Account Tax Compliance Act von 2010, der auf Grundlage des zwischenstaatlichen Abkommens zwischen Luxemburg und den USA, welches am 24. Juli 2015 vom Luxemburger Parlament ratifiziert wurde, in Luxemburg umgesetzt wurde
<b><u>FDI:</u></b>	Finanzderivat, einschließlich OTC-Derivate (Financial Derivative Instrument)
<b><u>FFI:</u></b>	Ausländisches Finanzinstitut (Foreign Financial Institution)
<b><u>FoM:</u></b>	Fund of Mandates
<b><u>GDR</u></b>	Global Depositary Receipts
<b><u>Hauptversammlung:</u></b>	Die Hauptversammlung der Anteilinhaber
<b><u>GIIN:</u></b>	Internationale Identifikationsnummer für Intermediäre (Global Intermediary Identification Number)
<b><u>High Yield:</u></b>	Diese Anlagen in Anleihen entsprechen den Ratings, die die Ratingagenturen Kreditgebern mit einer Bewertung zwischen BB+ und D auf der Bewertungsskala von Standard & Poor's oder Fitch und Ba1 und I auf der Bewertungsskala von Moody's zugewiesen haben. Diese Emissionen von Hochzinsanleihen sind Kredite, die in der Regel als Anleihen mit einer Laufzeit von 5, 7 oder 10 Jahren ausgegeben werden. Die Anleihen werden von Unternehmen mit schwacher Finanzbasis begeben. Die Renditen dieser Wertpapiere und ihr Risikoniveau sind beträchtlich, was sie hoch spekulativ macht.
<b><u>HKEX:</u></b>	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited
<b><u>HKSCC:</u></b>	Hong Kong Securities Clearing Company Limited, eine hundertprozentige Tochtergesellschaft von HKEX
<b><u>Gute Unternehmensführung:</u></b>	<p>Der Grundsatz der guten Unternehmensführung wird in der Offenlegungsverordnung klar dargelegt. Die Verwaltungsgesellschaft wendet diesen Grundsatz unter verschiedenen Gesichtspunkten an, um sicherzustellen, dass das Anlageprodukt Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung folgt: Das Titelauswahlverfahren des Fonds ist belastbar und transparent und verbindlich. Der Fonds investiert in Unternehmen, deren Unternehmensführungs-Praktiken nicht gegen internationale/lokale Normen verstoßen.</p> <p>Konkret bezieht sich gute Unternehmensführung auf solide Managementstrukturen, gute Beziehungen zu den Mitarbeitern, faire Entlohnung der Mitarbeiter und die Einhaltung von Steuervorschriften.</p>
<b><u>Impact:</u></b>	Die Teilfonds, die den Begriff „Impact“ in ihrer Bezeichnung verwenden, gelten als Fonds gemäß Artikel 9 der Offenlegungsverordnung und wenden die nachhaltige Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft an. Einige Anlageprodukte, die unter Artikel 9 fallen, verwenden möglicherweise nicht den entsprechenden Begriff in ihrer Bezeichnung (wie z. B. Themenfonds).
<b><u>Indirekte Gebühr:</u></b>	Laufende Gebühren, die bei den zugrunde liegenden OGAW und/oder OGA anfallen, in denen die Gesellschaft anlegt. Sie sind Bestandteil der in den wesentlichen Anlegerinformationen (soweit verfügbar) angegebenen laufenden Kosten.
<b><u>Institutionelle Anleger:</u></b>	Juristische Personen, die Anlagen für eigene Rechnung oder für Rechnung natürlicher Personen in Verbindung mit einem Gruppensparplan oder einem gleichwertigen Plan und OGA halten. Portfoliomanager, die im Rahmen von diskretionären individuellen Portfolioverwaltungsmandaten zeichnen, fallen nicht in diese Kategorie („Manager“).
<b><u>Investment Grade:</u></b>	Diese Anlagen in Anleihen entsprechen den Ratings, die die Ratingagenturen Kreditgebern mit einer Bewertung zwischen AAA und BBB- auf der Bewertungsskala von Standard & Poor's oder Fitch und Aaa und Baa3 auf der Bewertungsskala von Moody's zugewiesen haben
<b><u>Anlageverwalter:</u></b>	Die Anlageverwalter, an die die Verwaltungsgesellschaft Pflichten in Bezug auf die Gesellschaft übertragen hat
<b><u>IRS:</u></b>	Zinsswaps (Interest Rate Swaps)
<b><u>KIID:</u></b>	Wesentliche Anlegerinformationen (Key Investor Information Document)
<b><u>Gesetz:</u></b>	Das Luxemburger Gesetz vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren in seiner jeweils gültigen Fassung
<b><u>Gesetz vom 10. August 1915:</u></b>	Das Luxemburger Gesetz vom 10. August 1915 über die Handelsgesellschaften in seiner jeweils gültigen Fassung
<b><u>ManCo:</u></b>	Verwaltungsgesellschaft
<b><u>Verwaltungsgebühr:</u></b>	Gebühr, die täglich vom durchschnittlichen Nettovermögen eines Teilfonds, einer Anteilskategorie oder Anteilsklasse berechnet und erhoben wird, an die Verwaltungsgesellschaft gezahlt wird und dazu dient, die Vergütung der Vermögensverwalter sowie der Vertriebsstellen im Zusammenhang mit dem Vertrieb der Anteile der Gesellschaft abzudecken

<b><u>Manager:</u></b>	Portfoliomanager, die im Rahmen von diskretionären, individuellen Portfolioverwaltungsmandaten zeichnen
<b><u>Marktkapitalisierung:</u></b>	<b>Small Cap</b> Ein Unternehmen mit einer Marktkapitalisierung von weniger als 2 Milliarden Euro. <b>Mid Cap:</b> Ein Unternehmen mit einer Marktkapitalisierung zwischen 2 und 7 Milliarden Euro. <b>Large Cap:</b> Ein Unternehmen mit einer Marktkapitalisierung von über 7 Milliarden Euro Die oben genannten Marktkapitalisierungs-Schwellenwerte sind Richtwerte, da sie von Marktbewegungen abhängig sind und schwanken können, wie von Zeit zu Zeit (ohne vorherige Ankündigung) von der Verwaltungsgesellschaft festgelegt
<b><u>Market Timing:</u></b>	Arbitragetechnik, bei der ein Anleger systematisch kurzfristig Anteile oder Aktien eines einzelnen OGAW zeichnet und zurückgibt oder umtauscht, indem er die Zeitverschiebung und/oder Ungenauigkeiten oder Unzulänglichkeiten bei der Ermittlung des NIW des OGAW ausnutzt. Diese Technik ist von der Gesellschaft nicht zugelassen
<b><u>Geldmarktinstrumente:</u></b>	Instrumente, die üblicherweise auf dem Geldmarkt gehandelt werden, liquide sind und deren Wert jederzeit genau bestimmt werden kann
<b><u>Geldmarktfonds:</u></b>	Geldmarktfonds gemäß ESMA-Leitlinien (CESR/10-049 vom 19. Mai 2010)
<b><u>Nationale Datenschutzkommission:</u></b>	Die durch das Gesetz vom 2. August 2002 über den Schutz natürlicher Personen bei der Verarbeitung personenbezogener Daten errichtete unabhängige Behörde
<b><u>NIW oder Nettoinventarwert:</u></b>	Der Nettoinventarwert
<b><u>Northbound:</u></b>	der Handel von SSE- oder SZSE-Wertpapieren durch Anleger in Hongkong und dem Ausland über den entsprechenden Trading Link.
<b><u>OECD:</u></b>	Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung
<b><u>Einmalige Aufwendungen:</u></b>	Aufwendungen außer Verwaltungs-, Erfolgs- und sonstigen nachfolgend beschriebenen Gebühren, die von jedem Teilfonds getragen werden. Diese Kosten umfassen u. a. Rechtskosten, Steuern, Abgaben oder diverse Gebühren, die den Teilfonds auferlegt werden und nicht als ordentliche Aufwendungen gelten
<b><u>OTC:</u></b>	Im Freiverkehr gehandelt (Over The Counter)
<b><u>Sonstige Gebühren:</u></b>	Gebühren, die täglich vom durchschnittlichen Nettovermögen eines Teilfonds, einer Anteilskategorie oder einer Anteilklasse berechnet und abgezogen werden und die zur Deckung allgemeiner Vermögensverwahrungsaufwendungen (Vergütung der Verwahrstelle), Vergütungen des Verwaltungsrats und der täglichen Verwaltungsaufwendungen dienen (NIW-Berechnung, Aufzeichnungen und Buchführung, Mitteilungen an die Anteilinhaber, Erstellung und Druck der gesetzlich für die Anteilinhaber und für die Luxemburger Aufsichtsbehörde erforderlichen Dokumente, Gebühren in Verbindung mit der Registrierung der Gesellschaft bei einer ausländischen lokalen Behörde und der Aufrechterhaltung dieser Registrierung, Gebühren in Verbindung mit der Übersetzung des Prospekts, des KIID und sonstiger gesetzlich erforderlicher Dokumente, KIID-Produktionskosten, Gebühren in Verbindung mit der Produktion von Informationsblättern und anderen Marketing-Dokumenten, Notierungsgebühren, Domizilierungs-, Prüfungskosten und -gebühren usw.), außer Brokerggebühren, Provisionen für nicht mit der Einlage verbundene Transaktionen, Zinsen und Bankgebühren, einmaligen Aufwendungen und der in Luxemburg geltenden <i>Taxe d'Abonnement</i> sowie sonstigen spezifischen ausländischen Steuern.
<b><u>PAIs:</u></b>	Die Offenlegungsverordnung definierte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principal Sustainability Adverse Impacts, PAI) auf die Nachhaltigkeit als negative – wesentliche oder wahrscheinlich wesentliche – Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, die durch die Anlageentscheidungen der Verwaltungsgesellschaft hervorgerufen werden können, dazu beitragen oder direkt damit verbunden sind. In diesem Stadium wird die Offenlegungsverordnung als eine Reihe von nachhaltigen Richtlinien und Verpflichtungen verstanden, die von der Verwaltungsgesellschaft unterstützt werden. Künftig sollte die Analyse auf Portfolioebene (Teilfonds) erfolgen
<b><u>Passive Fonds:</u></b>	Anlageinstrumente, die den Aktienmarkt, einen Marktindex oder einen bestimmte Bereich des Marktes nachbilden
<b><u>VRC:</u></b>	Die Volksrepublik China
<b><u>Prospekt:</u></b>	Dieses Dokument (einschließlich Teil I und Teil II)
<b><u>Quantitative Fonds:</u></b>	Anlageinstrumente, die quantitative Anlagemanagementtechniken anstelle einer menschlichen Fundamentaldatenanalyse verwenden
<b><u>Immobilienanlagen:</u></b>	Anlagen in Immobilienzertifikaten, Anteilen an Unternehmen, die in verwandten Bereichen des Immobiliensektors tätig sind, immobilienbasierten OGAW/OGA, geschlossenen und/oder offenen Organismen für gemeinsame Anlagen in Immobilien, REIT-Produkten (und Produkten mit REIT entsprechendem Status in nationalem Recht, z. B. SICAFI in Belgien, SIIC in Frankreich usw.), immobilienbasierten derivativen Finanzinstrumenten, an Immobilienindizes gebundenen ETF
<b><u>Referenzwährung:</u></b>	Hauptwährung, wenn für die gleiche Anteilskategorie verschiedene Bewertungswährungen verfügbar sind
<b><u>Sensitivität:</u></b>	Die Sensitivität ist ein in Prozent ausgedrückter Indikator, der verwendet wird, um den Anstieg oder Rückgang des Preises einer Anleihe oder des Nettoinventarwerts eines Anleihenfonds zu messen, der durch die Schwankungen des Marktinzins verursacht wird. Die Sensitivität hängt von der Höhe des Zinssatzes und der Laufzeit der Wertpapiere ab.
<b><u>SEHK:</u></b>	Die Stock Exchange of Hong Kong Limited, eine hundertprozentige Tochtergesellschaft von HKEX
<b><u>Offenlegungsverordnung:</u></b>	Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor. Ziel der Offenlegungsverordnung ist es, in standardisierter Form mehr Transparenz über Nachhaltigkeit auf den Finanzmärkten zu schaffen, um so Greenwashing zu verhindern und die Vergleichbarkeit von Produkten zu gewährleisten.  Diese Verordnung kategorisiert Anlageprodukte in drei Gruppen:  Produkte, die nachhaltige Investitionen anstreben (Artikel 9) – das Anlageprodukt trägt zu den ökologischen bzw. sozialen Zielen bei (mit messbaren Zielen). Das Ziel des Fonds ist es, eine positive Auswirkung in ökologischen und/oder sozialen Bereichen zu erzielen, wobei keine wesentlichen

ökologischen bzw. sozialen Ziele beeinträchtigt werden und eine gute Unternehmensführung berücksichtigt wird • Der Grad des Engagements für Nachhaltigkeit ist hoch und steht im Einklang mit der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft.

ESG-Produkte (Artikel 8) – das Anlageprodukt fördert ökologische bzw. soziale Merkmale. Das Ziel des Fonds ist es, ökologische und/oder soziale Merkmale und finanzielle Ziele unter Berücksichtigung einer guten Unternehmensführung zu erzielen • Der Grad des Engagements für Nachhaltigkeit ist hoch und steht im Einklang mit der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft.

Weitere Produkte: Artikel 6 (Produkte, die diese Voraussetzungen nicht erfüllen): Ökologische bzw. soziale Merkmale sind nicht ausschlaggebend oder nicht Teil des Anlageverfahrens • Der Grad des Engagements für Nachhaltigkeit ist gering. Alle Produkte sollten die grundlegenden Schutzmaßnahmen im Hinblick auf Umwelt und Soziales der Verwaltungsgesellschaft anwenden und offenlegen, ob und wie Nachhaltigkeitsrisiken in die Anlageentscheidungen einbezogen werden.

**SICAFI:**

„Société d'investissement à capital fixe“, geschlossenes Immobilien-Anlageinstrument unter belgischem Recht

**Sustainable:**

Bei den Teilfonds, die den Begriff „Sustainable“ in ihrer Bezeichnung verwenden, wird davon ausgegangen, dass sie mindestens die Anforderungen von Artikel 8 der Offenlegungsverordnung erfüllen und die nachhaltige Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft anwenden. Einige Anlageprodukte, die unter Artikel 8 der Offenlegungsverordnung fallen, verwenden möglicherweise nicht den entsprechenden Begriff in ihrer Bezeichnung (wie z. B. Themenfonds).

**Nachhaltigkeitsfaktoren:**

Sammelbegriff für in Bezug auf Umwelt, Soziales und Mitarbeiter, Achtung der Menschenrechte, Aspekte hinsichtlich der Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

**Nachhaltigkeitsrisiken:**

Gemäß der Offenlegungsverordnung sind Nachhaltigkeitsrisiken Ereignisse oder Bedingungen im Bereich Umwelt, Soziales oder Unternehmensführung, die bei Eintreten tatsächliche oder potenzielle wesentliche negative Auswirkungen auf den finanziellen Wert des Anlageprodukts haben.

Um die Nachhaltigkeitsrisiken ihrer Portfolios zu messen, verwendet die Verwaltungsgesellschaft das ESG-Risiko-Rating von Sustainalytics, um Portfolioanalysen durchzuführen. Die Verwaltungsgesellschaft ist außerdem der Ansicht, dass die größten Nachhaltigkeitsrisiken vermieden oder minimiert werden, da die Teilfonds ihre Ausschlussliste(n) einhalten müssen.

**SSE:**

die Shanghai Stock Exchange

**STP:**

Elektronische Verarbeitung von Transaktionen ohne erforderliche Neueingabe oder manuelle Eingriffe (Straight-Through Processing)

**Swing-Pricing-Anpassung:**

wie in Teil I, Abschnitt „Nettoinventarwert“, „Swing Pricing“ definiert

**Swing-Faktor:**

wie in Teil I, Abschnitt „Nettoinventarwert“, „Swing Pricing“ definiert

**Swing-Pricing-Schwellenwert:**

wie in Teil I, Abschnitt „Nettoinventarwert“, „Swing Pricing“ definiert

**Tracking Error:**

Der Tracking Error bzw. das aktive Risiko ist eine Kennzahl für das Risiko eines Anlageportfolios, das durch die aktiven Verwaltungsentscheidungen eines Portfolioverwalters bedingt ist; sie gibt an, wie genau das Portfolio den Benchmarkindex abbildet, auf den es Bezug nimmt. Der Tracking Error ergibt sich aus der Differenz zwischen der Rendite eines Anlageverwalters und der Rendite seines Benchmarkindex, und er wird als Standardabweichung der jeweiligen Differenz zwischen der Rendite des Anlageverwalters und der Rendite seines Benchmarkindex über verschiedene Zeiträume berechnet. Das Portfolio eines Teilfonds kann in erheblichem Maße mit der Performance und der Zusammensetzung eines Benchmarkindex übereinstimmen. Es besteht jedoch keine Garantie, dass er eine perfekte Übereinstimmung der Performance erreichen oder anstreben wird, und der Teilfonds unterliegt möglicherweise einem Tracking Error, wodurch die Renditen gegebenenfalls nicht exakt mit jenen des jeweiligen Benchmarkindex übereinstimmen. Dieser Tracking Error kann aus anfallenden Betriebsgebühren und -aufwendungen bezüglich des Teilfonds resultieren. Der Tracking Error kann auch durch aufsichtsrechtliche oder marktbedingte Beschränkungen entstehen, die die Anlage in bestimmten Arten von Vermögenswerten einschränken und damit die Portfoliogewichtungen im Vergleich zum Benchmarkindex beeinträchtigen.

**Taxonomie:**

Verordnung (EU) 2020/852 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 18. Juni 2020 über die Einrichtung eines Rahmens zur Erleichterung nachhaltiger Investitionen und zur Änderung der Verordnung (EU) 2019/2088. Die EU-Taxonomie besteht aus einer Liste von wirtschaftlichen Aktivitäten, die zu Anlagezwecken als ökologisch nachhaltig gelten. Die Taxonomie identifiziert diese Aktivitäten mit Leistungskriterien für ihren Beitrag zu sechs wichtigen Umweltzielen: Eindämmung des Klimawandels, Anpassung an den Klimawandel, nachhaltige Nutzung und Schutz von Wasser- und Meeresressourcen, Übergang zur Kreislaufwirtschaft (Abfall, Vermeidung und Recycling), Vermeidung und Kontrolle von Umweltverschmutzung sowie Schutz gesunder Ökosysteme.

Das Ziel der EU-Regulierungsbehörde ist es, den Grad der ökologischen Nachhaltigkeit eines Anlageprodukts bei Erreichen von Umweltzielen zu bestimmen und sicherzustellen, dass ein nachhaltiges Anlageprodukt diesen Zielen und anderen nachhaltigen Zielen nicht wesentlich schadet.

**OGA:**

Organismus für gemeinsame Anlagen

**OGAW:**

Organismus/Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren

**Grundsätze des UN Global Compact:**

Die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen für Unternehmen, wie auf der Website des UN GC (<https://www.unglobalcompact.org/what-is-gc/mission/principles>) definiert. Der UN GC umfasst zehn Grundsätze, die einen globalen Standard für Unternehmen darstellen, und beinhaltet Best Practices in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung. Die Teilfonds, die diese Grundsätze einhalten, verweisen in der Anlagepolitik ausdrücklich auf die Grundsätze des UN Global Compact, die dann verbindlich sind. Ein Unternehmen mit Nichteinhaltungsstatus gilt als sehr umstritten und sollte aus dem Portfolio des Teilfonds ausgeschlossen werden

**UN PRI**

Die Prinzipien für verantwortliches Investieren der Vereinten Nationen, wie auf der PRI-Website der Vereinten Nationen definiert (<https://www.unpri.org/pri/an-introduction-to-responsible-investment/what-are-the-principles-for-responsible-investment>), umfassen sechs Grundsätze, die einen globalen Standard für verantwortliche Investitionen im Zusammenhang mit ESG-Faktoren bieten. Die Teilfonds, die diese Grundsätze einhalten, verweisen in der Anlagepolitik ausdrücklich auf die UN PRI, die dann verbindlich sind.

**US-Person:**

Definiert in der Regulation S der US-amerikanischen SEC (Part 230 – 17 CFR 230.903) und alle sonstigen Personen oder Rechtssubjekte, die Anteile halten oder die, wenn sie Anteile halten würden, solche Umstände herbeiführen würden (unabhängig davon, ob diese die Personen oder Rechtssubjekte direkt oder indirekt betreffen oder ob diese Personen oder Rechtssubjekte einzeln oder zusammen mit einer oder mehreren anderen Personen oder Rechtssubjekten, ob verbunden oder nicht, oder in Verbindung mit sonstigen Umständen anzusehen sind), die nach Ansicht des Verwaltungsrats der Gesellschaft dazu führen könnten, dass der Gesellschaft Verbindlichkeiten nach US-Steuerrecht entstehen oder sie einen monetären, rechtlichen oder administrativen Nachteil erleidet, den sie sonst möglicherweise nicht erlitten hätte

**Bewertungswährung(en):**

Währung, in der die NIW eines Teilfonds, einer Anteilskategorie oder einer Anteilsklasse berechnet werden. Ein Teilfonds, eine Anlagekategorie oder eine Anteilsklasse kann verschiedene Bewertungswährungen haben (die sogenannte „Multi-Currency“-Option). Wenn die für die Anteilskategorie oder Anteilsklasse verfügbare Währung von der Rechnungswährung abweicht, können Anträge auf Zeichnung/Umtausch/Rücknahme berücksichtigt werden, ohne dass Wechselkursgebühren entstehen

**Bewertungstag:**

Jeder Bankarbeitstag in Luxemburg, vorbehaltlich der in Teil II genannten Ausnahmen. Er entspricht außerdem:

- Dem Datum, mit dem der NIW bei seiner Veröffentlichung versehen wird;
- Dem Handelsdatum, mit dem Aufträge versehen werden;
- Im Hinblick auf Ausnahmen in den Bewertungsregeln den Schlusskursen, die für die Bewertungsmethode der zugrunde liegenden Vermögenswerte in den Teilfondsportfolios verwendet werden

**VaR:**

Value-at-Risk, spezielle Methode zur Bewertung der Risiken eines Teilfonds (siehe Anhang 2)

# **ABN AMRO Funds**

Kurzbezeichnung oder AAF

## **TEIL I DES PROSPEKTS**



---

## ALLGEMEINE BESTIMMUNGEN

---

ABN AMRO Funds ist eine offene Investmentgesellschaft (*Société d'Investissement à Capital Variable* – abgekürzt *SICAV*). Sie wurde am 17. November 2000 nach luxemburgischem Recht für einen unbestimmten Zeitraum unter dem Namen „A.A. ADVISORS Multi-Manager Funds“ gemäß den Bestimmungen von Teil II des Luxemburger Gesetzes vom 30. März 1988 zu Organismen für gemeinsame Anlagen gegründet. Sie wurde auf Beschluss bei der außerordentlichen Hauptversammlung am 31. Mai 2019 mit Wirkung zum 1. Juli 2019 in „ABN AMRO Funds“ umbenannt.

Der vollständige Name „ABN AMRO Funds“ und die Kurzbezeichnung „AAF“ können in offiziellen und geschäftlichen Dokumenten der Gesellschaft gleichberechtigt verwendet werden.

Die Gesellschaft unterliegt derzeit den Bestimmungen von Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen sowie der Richtlinie 2009/65.

Das Kapital der Gesellschaft wird in Euro („**EUR**“) angegeben und entspricht jederzeit dem gesamten Nettovermögen der verschiedenen Teilfonds. Es wird durch vollständig eingezahlte nennwertlose Anteile gemäß der Beschreibung im nachstehenden Abschnitt „**Anteile**“ repräsentiert. Kapitalveränderungen erfolgen automatisch und ohne die bei Kapitalerhöhungen und -herabsetzungen von Aktiengesellschaften vorgeschriebenen Veröffentlichungen und Eintragungen. Ihr Mindestkapital ist vom Gesetz festgelegt.

Die Gesellschaft ist im Luxemburger Handelsregister unter der Nummer B 78 762 eingetragen.

Die Gesellschaft ist ein Umbrellafonds mit mehreren Teilfonds, die jeweils unterschiedliche Vermögenswerte und Verbindlichkeiten aufweisen. Jeder Teilfonds verfügt über eine jeweils eigene Anlagepolitik und Referenzwährung, die vom Verwaltungsrat festgelegt werden.

Die Gesellschaft ist eine einzige juristische Person.

Gemäß Artikel 181 des Gesetzes:

- beschränken sich die Rechte der Anteilhaber und Gläubiger im Hinblick auf einen Teilfonds oder die Rechte, die im Zusammenhang mit der Gründung, der Verwaltung oder der Liquidation eines Teilfonds entstehen, auf die Vermögenswerte dieses Teilfonds;
- sind die Vermögenswerte eines Teilfonds das ausschließliche Eigentum der Anteilhaber dieses Teilfonds sowie der Gläubiger, wenn das Guthaben aus der Gründung, der Verwaltung oder der Liquidation des Teilfonds entsteht;
- wird im Verhältnis der Anteilhaber untereinander jeder Teilfonds als eigenständige Einheit behandelt.

Der Verwaltungsrat kann jederzeit weitere Teilfonds auflegen, deren Anlagepolitik und Verkaufsmodalitäten zum gegebenen Zeitpunkt durch Aktualisierung des Verkaufsprospekts bekannt gegeben werden. Informationen an die Anteilhaber sind auch über Veröffentlichungen in der Presse möglich, sofern dies durch die Bestimmungen vorgeschrieben oder vom Verwaltungsrat als geeignet erachtet wird. Ebenso kann der Verwaltungsrat gemäß den Bestimmungen in Anhang 5 Teilfonds schließen.

---

## VERWALTUNG

---

Die Gesellschaft wird durch den Verwaltungsrat geleitet und vertreten, der den Weisungen der Hauptversammlung untersteht. Die Gesellschaft gliedert die Verwaltungs-, Abschlussprüfungs- und Depotdienstleistungen aus. Die mit diesen Funktionen verbundenen Aufgaben und Zuständigkeiten sind nachfolgend beschrieben. Die Zusammensetzung des Verwaltungsrats und die Namen, Adressen und genauen Angaben zu den Dienstleistern sind vorstehend unter „Allgemeine Informationen“ aufgeführt.

Die Verwaltungsgesellschaft, die Anlageverwalter, die Verwahrstelle, die Verwaltungsstelle, die Vertriebsstellen und die sonstigen Dienstleistungserbringer und ihre jeweiligen verbundenen Unternehmen, Verwaltungsratsmitglieder, Leiter und Anteilinhaber (die „Parteien“) gehen anderen finanziellen, mit Anlagen verbundenen und geschäftlichen Tätigkeiten nach bzw. können diesen nachgehen, aus denen sich Interessenkonflikte mit der Verwaltung der Gesellschaft ergeben können. Dazu gehören die Verwaltung anderer Fonds, der Kauf und Verkauf von Wertpapieren, Maklerdienste, die Hinterlegung und Verwahrung von Wertpapieren und die Tatsache, dass jemand als Verwaltungsratsmitglied, Leiter, Berater oder Beauftragter für andere Fonds oder Gesellschaften handelt, einschließlich Gesellschaften, in die ein Teilfonds investieren könnte. Jede der Parteien gewährleistet, dass die Erfüllung ihrer jeweiligen Pflichten nicht durch ihre diesbezüglich möglichen anderen Engagements beeinträchtigt wird. Liegt ein Interessenkonflikt vor, müssen die Verwaltungsratsmitglieder und die betroffenen Parteien diesen Konflikt auf gerechte Weise, innerhalb einer angemessenen Frist und im Interesse der Gesellschaft beilegen.

### Verwaltungsrat

Der Verwaltungsrat übernimmt in letzter Instanz Verantwortung für die Verwaltung der Gesellschaft und ist daher für die Definition und Umsetzung der Anlagepolitik der Gesellschaft verantwortlich.

Der Verwaltungsrat hat François-Xavier GENNETAIS (Managing Director) Aufgaben in Bezug auf die tägliche Verwaltungstätigkeit für die Gesellschaft (einschließlich dem Recht, als Prokurist der Gesellschaft aufzutreten) und deren Vertretung nach außen übertragen.

### Verwaltungsgesellschaft

ABN AMRO Investment Solutions ist eine am 18. Dezember 1998 gegründete Aktiengesellschaft nach französischem Recht (*Société Anonyme*) und Teil der ABN AMRO Gruppe.

Die Verwaltungsgesellschaft erfüllt die Aufgaben der Verwaltung, der Portfolioverwaltung und der Vermarktung im Auftrag der Gesellschaft.

Die Verwaltungsgesellschaft ist berechtigt, unter ihrer eigenen Verantwortung und auf eigene Kosten einige oder alle dieser Aufgaben an Dritte ihrer Wahl zu übertragen.

Mit dieser Berechtigung hat sie Folgendes übertragen:

- die Berechnung des NIW sowie die Aufgaben der Transfer- und Registerstelle an die STATE STREET BANK INTERNATIONAL GMBH, NIEDERLASSUNG LUXEMBURG (die „Registerstelle“);
- die Verwaltung der Beteiligungen der Gesellschaft und die Einhaltung ihrer Anlagepolitik und -beschränkungen an die vorstehend im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ aufgeführten Anlageverwalter. Eine Liste der Anlageverwalter, die effektiv für die Verwaltung verantwortlich sind, sowie Einzelheiten zu den verwalteten Portfolios finden Sie im Anhang der regelmäßigen Berichte der Gesellschaft. Anleger können bei der Verwaltungsgesellschaft kostenlos eine aktualisierte Liste der Anlageverwalter anfordern, in der die von diesen jeweils verwalteten Portfolios angegeben sind.

Bei der Durchführung von Wertpapiertransaktionen und der Auswahl von Brokern, Händlern oder sonstigen Gegenparteien werden die Verwaltungsgesellschaft und alle Anlageverwalter mit gebührender Sorgfalt die insgesamt besten verfügbaren Bedingungen identifizieren. Bei allen Transaktionen gehört hierzu die Abwägung aller als relevant angesehenen Faktoren wie der Marktbreite, der Wertpapierkurse sowie der Finanzlage und der Fähigkeit der Gegenpartei zur Orderausführung. Ein Anlageverwalter kann Gegenparteien innerhalb der ABN AMRO Gruppe wählen, sofern deren Angebot offenbar die insgesamt besten verfügbaren Bedingungen bietet.

Die Verwaltungsgesellschaft kann zudem beschließen, Vertriebsstellen/Nominees zu ernennen, um beim Vertrieb der Anteile der Gesellschaft in den Ländern, in denen sie beworben werden, zu helfen.

Zwischen der Verwaltungsgesellschaft und den verschiedenen Vertriebsstellen/Nominees werden Vertriebs- und Nomineevertäge geschlossen.

Gemäß dem Vertriebs- und Nomineevertag wird der Nominee anstelle des tatsächlichen Anteilinhabers in das Register der Anteilinhaber eingetragen.

Anteilinhaber, die über einen Nominee in die Gesellschaft investiert haben, können jederzeit die Übertragung der über den Nominee gezeichneten Anteile auf ihren eigenen Namen beantragen. In diesem Fall werden Anteilinhaber in ihrem eigenen Namen in das Register der Anteilinhaber eingetragen, sobald die Übertragungsanweisung vom Nominee eingegangen ist.

Anleger können Anteile der Gesellschaft direkt zeichnen, ohne über eine Vertriebsstelle/einen Nominee zeichnen zu müssen.

Die Gesellschaft weist die Anleger darauf hin, dass ein Anleger seine Anlegerrechte gegenüber der Gesellschaft (insbesondere das Recht der Teilnahme an den Hauptversammlungen der Anteilinhaber) nur dann vollumfänglich wahrnehmen kann, wenn der Anleger selbst in seinem eigenen Namen im Register der Anteilinhaber der Gesellschaft eingetragen ist. In Fällen, in denen ein Anleger über einen Finanzintermediär in die Gesellschaft anlegt, der auf eigenen Namen, jedoch für Rechnung des Anlegers handelt, kann der Anleger bestimmte Anlegerrechte gegenüber der Gesellschaft möglicherweise nicht immer direkt wahrnehmen. Anlegern wird empfohlen, sich hinsichtlich ihrer Rechte beraten zu lassen.

### Vergütung

Die Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft entspricht und fördert ein solides und effizientes Risikomanagement und ermutigt nicht zu einer Risikobereitschaft, die nicht mit dem Risikoprofil, den Regeln oder der Satzung der verwalteten Fonds vereinbar ist.

Die Vergütungspolitik spiegelt die Ziele der Verwaltungsgesellschaft für eine gute Unternehmensführung sowie eine nachhaltige und langfristige Wertschöpfung für die Anteilinhaber wider. Die Vergütungspolitik wurde entwickelt und umgesetzt, um:

- das Erreichen der Strategie und Ziele der Verwaltungsgesellschaft aktiv zu unterstützen;
- die Wettbewerbsfähigkeit der Verwaltungsgesellschaft auf den Märkten, auf denen sie tätig ist, zu unterstützen;
- leistungsstarke und motivierte Mitarbeiter gewinnen, weiterentwickeln und binden zu können.

Den Mitarbeitern der Verwaltungsgesellschaft wird ein wettbewerbsfähiges und marktorientiertes Vergütungspaket geboten, bei dem feste Gehälter einen wesentlichen Bestandteil ihres Gesamtpakets ausmachen.

Die Grundsätze der Vergütungspolitik werden regelmäßig überprüft und an die Entwicklung des Regelungsrahmens angepasst. Die Vergütungspolitik wurde vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft genehmigt.

Ein Druckexemplar der Vergütungspolitik wird auf Anfrage kostenlos zur Verfügung gestellt.

Die Einzelheiten der aktuellen Vergütungspolitik, einschließlich u.a. einer Beschreibung, wie die Vergütung und Leistungen berechnet werden oder der Identität der für die Verteilung der Vergütung und Leistungen zuständigen Personen einschließlich der Zusammensetzung des Vergütungsausschusses, wenn ein solcher Ausschuss vorhanden ist, können auf der folgenden Webseite eingesehen werden, sobald diese von der AMF zugelassen wurde: <https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/footer/regulatory-information.html>. Ein Druckexemplar der Vergütungspolitik wird auf Anfrage kostenlos zur Verfügung gestellt.

### Verwahrstelle

Die Gesellschaft hat State Street Bank International GmbH, handelnd durch die Niederlassung Luxemburg, gemäß dem Verwahrstellenvertrag zu ihrer Verwahrstelle im Sinne des Gesetzes ernannt. State Street Bank International GmbH ist eine Gesellschaft mit beschränkter Haftung nach deutschem Recht mit eingetragenem Sitz in Brienner Str. 59, 80333 München, Deutschland, und im Handelsregister München unter der Nummer HRB 42872 eingetragen. Es handelt sich um ein Kreditinstitut, das von der Europäischen Zentralbank, der Deutschen Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht („BaFin“) und der Deutschen Bundesbank beaufsichtigt wird. State Street Bank International GmbH, Niederlassung Luxemburg, ist durch die CSSF in Luxemburg befugt, als Verwahrstelle zu agieren und auf die Bereiche Verwahrung, Fondsverwaltung und damit verbundene Dienstleistungen spezialisiert. State Street Bank International GmbH, Niederlassung Luxemburg, ist im Handels- und Firmenregister Luxemburg („RCS“) unter der Nummer B 148 186 eingetragen. State Street Bank International GmbH gehört zur Unternehmensgruppe State Street, als deren oberste Muttergesellschaft State Street Corporation fungiert, eine in den USA börsennotierte Gesellschaft.

### Aufgaben der Verwahrstelle

Die Beziehung zwischen der Gesellschaft und der Verwahrstelle unterliegt den Bestimmungen des Verwahrstellenvertrags. Gemäß den Bedingungen des Verwahrstellenvertrags wird die Verwahrstelle mit folgenden Hauptaufgaben betraut:

- Sicherstellung, dass der Verkauf, die Ausgabe, der Rückkauf, die Rücknahme und die Löschung von Anteilen gemäß den geltenden Gesetzen und dem Verwaltungsreglement bzw. der Satzung erfolgt;
- Sicherstellung, dass der Wert der Anteile gemäß den geltenden Gesetzen und dem Verwaltungsreglement bzw. der Satzung berechnet wird;
- Ausführung der Anweisungen der Verwaltungsgesellschaft/Gesellschaft, sofern diese nicht den geltenden Gesetzen und dem Verwaltungsreglement bzw. der Satzung widersprechen;
- Sicherstellung, dass bei Transaktionen mit den Vermögenswerten der Gesellschaft das Entgelt innerhalb der üblichen Fristen gezahlt wird.
- Sicherstellung, dass die Einnahmen des OGAW gemäß den geltenden Gesetzen und dem Verwaltungsreglement bzw. der Satzung verwendet werden.
- Überwachung der Barmittel und Cashflows der Gesellschaft
- Verwahrung der Vermögenswerte der Gesellschaft, was die Verwahrung der zu verwahrenden Finanzinstrumente sowie die Verifizierung der Eigentumsrechte und das Führen von Aufzeichnungen in Bezug auf andere Vermögenswerte umfasst.

### Haftung der Verwahrstelle

Im Falle eines Verlustes eines verwahrten Finanzinstruments, wie gemäß Richtlinie 2009/65 und insbesondere Artikel 18 des Gesetzes bestimmt, hat die Verwahrstelle der Gesellschaft bzw. Verwaltungsgesellschaft, die im Namen der Gesellschaft handelt, ohne schuldhaftes Zögern Finanzinstrumente desselben Typs oder den entsprechenden Betrag zurückzuerstatten.

Die Verwahrstelle haftet nicht, wenn sie nachweisen kann, dass der Verlust eines verwahrten Finanzinstruments auf ein externes Ereignis außerhalb ihres Einflussbereiches zurückzuführen ist, dessen Folgen gemäß Richtlinie 2009/65 entgegen aller zumutbaren Anstrengungen unvermeidlich gewesen wären.

Im Falle eines Verlustes eines verwahrten Finanzinstruments können die Anteilinhaber die Haftung der Verwahrstelle direkt oder indirekt durch die Gesellschaft geltend machen, sofern dies nicht zu einer Doppelung der Entschädigung oder zu einer Ungleichbehandlung der Anteilinhaber führt.

Die Verwahrstelle haftet gegenüber der Gesellschaft für alle sonstigen der Gesellschaft entstandenen Schäden, die darauf zurückzuführen sind, dass die Verwahrstelle ihre Pflichten fahrlässig oder vorsätzlich nicht ordnungsgemäß im Sinne der Richtlinie 2009/65 erfüllt hat.

Die Verwahrstelle haftet nicht für Folgeschäden oder indirekte oder besondere Schäden oder Verluste, die aufgrund oder im Zusammenhang mit der Erfüllung oder Nichterfüllung ihrer Pflichten und Aufgaben entstehen.

### Übertragung

Die Verwahrstelle ist uneingeschränkt berechtigt, die Gesamtheit oder einen Teil ihrer Verwahrungsaufgaben zu übertragen; ihre Haftung wird jedoch nicht durch die Tatsache, dass sie einem Dritten einige oder alle der Vermögenswerte in ihrer Verwahrung anvertraut hat, berührt. Die Haftung der Verwahrstelle wird nicht von Übertragungen ihrer Verwahrungsaufgaben gemäß dem Verwahrstellenvertrag berührt.

Die Verwahrstelle hat die in Artikel 22(5)(a) der Richtlinie 2009/65 genannten Verwahrungspflichten an die State Street Bank and Trust Company mit eingetragenem Sitz One Congress Street, Suite 1, Massachusetts 02114-02116, USA, übertragen, die sie zu ihrer weltweiten Unterverwahrstelle ernannt hat. Die State Street Bank and Trust Company hat als weltweite Unterverwahrstelle lokale Unterverwahrstellen innerhalb des Custody-Netzwerks von State Street Global ernannt.

Informationen über die übertragenen Verwahrungsfunktionen und die Liste der Beauftragten und Unterbeauftragten stehen am eingetragenen Sitz der Verwahrstelle und über den folgenden Link zur Verfügung: [www.statestreet.com/about/office-locations/luxembourg/subcustodians.html](http://www.statestreet.com/about/office-locations/luxembourg/subcustodians.html).

### Interessenkonflikte

Die Verwahrstelle ist Teil einer internationalen Gruppe von Gesellschaften und Unternehmen, die in ihrem gewöhnlichen Geschäftsverkehr gleichzeitig für eine große Anzahl an Kunden sowie auf eigene Rechnung handeln, was zu tatsächlichen oder potenziellen Konflikten führen kann. Interessenkonflikte entstehen, wenn die Verwahrstelle oder ihre verbundenen Unternehmen Tätigkeiten gemäß dem Verwahrstellenvertrag oder gemäß separater vertraglicher oder sonstiger Vereinbarungen ausführen. Dazu können folgende Tätigkeiten gehören:

- (i) die Bereitstellung von Dienstleistungen als Nominee, Verwaltungsstelle, Register- und Transferstelle, Analyseleistungen, Anlageverwaltung, Finanzberatung und/oder sonstige Beratungsdienstleistungen für die Gesellschaft;
- (ii) die Durchführung von Bankgeschäften, Verkaufs- und Handelsgeschäften, einschließlich Devisen- und Derivategeschäften, Brokertätigkeiten, Market Making oder anderer Finanztransaktionen, wobei die Gesellschaft entweder als Eigenhändler und für ihre eigenen Interessen oder für andere Kunden handelt.

Im Zusammenhang mit den oben genannten Tätigkeiten wird die Verwahrstelle bzw. werden die mit ihr verbundenen Unternehmen:

- (i) versuchen, aus diesen Tätigkeiten einen Gewinn zu erwirtschaften, wobei sie berechtigt sind, etwaige Gewinne oder Entgelte in jeglicher Form zu vereinnahmen und einzubehalten und nicht verpflichtet sind, die Art oder die Höhe solcher Gewinne oder Entgelte, einschließlich aller Gebühren, Abgaben, Provisionen, Umsatzbeteiligungen, Spreads, Auf- und Abschläge, Zinsen, Rückvergütungen, Rabatte oder sonstigen in Verbindung mit derartigen Tätigkeiten erhaltenen Vorteile gegenüber der Gesellschaft offenzulegen;
- (ii) unter Umständen Wertpapiere oder sonstige Finanzprodukte oder -instrumente als Auftraggeber, der in eigenem Interesse, im Interesse seiner verbundenen Unternehmen oder für seine sonstigen Kunden handelt, kaufen, verkaufen, ausgeben, handeln oder halten;
- (iii) unter Umständen in die gleiche oder entgegengesetzte Richtung wie die getätigten Transaktionen handeln, einschließlich auf der Grundlage von eigenen Informationen, die der Gesellschaft nicht zur Verfügung stehen;
- (iv) unter Umständen für andere Kunden dieselben oder ähnliche Dienstleistungen erbringen, einschließlich für Wettbewerber der Gesellschaft;
- (v) unter Umständen Gläubigerrechte von der Gesellschaft eingeräumt bekommen, zu deren Ausübung sie berechtigt ist bzw. sind.

Die Gesellschaft kann ein verbundenes Unternehmen der Verwahrstelle zur Durchführung von Devisen-, Spot- oder Swaptransaktionen auf Rechnung der Gesellschaft einsetzen. In solchen Fällen handelt das verbundene Unternehmen als Auftraggeber und nicht als Makler, Beauftragter oder Treuhänder der Gesellschaft. Das verbundene Unternehmen wird versuchen, aus diesen Transaktionen einen Gewinn zu erwirtschaften und ist berechtigt, etwaige Gewinne einzubehalten und sie der Gesellschaft nicht offenzulegen.

Das verbundene Unternehmen geht derartige Transaktionen zu den mit der Gesellschaft vereinbarten Bedingungen ein.

Wenn Barmittel der Gesellschaft bei einem verbundenen Unternehmen eingezahlt werden, das eine Bank ist, entsteht ein potenzieller Konflikt in Bezug auf die gegebenenfalls anfallenden Zinsen, die das verbundene Unternehmen einem derartigen Konto zahlt oder berechnet, sowie in Bezug auf die Gebühren oder sonstigen Vorteile, die es daraus zieht, dass es diese Barmittel als Bank und nicht als Treuhänder verwahrt. Die Verwaltungsgesellschaft kann auch ein Kunde oder eine Gegenpartei der Verwahrstelle oder ihrer verbundenen Unternehmen sein.

Potenzielle Konflikte, die beim Einsatz von Unterdepotbanken durch die Verwahrstelle entstehen können, lassen sich in vier grobe Kategorien unterteilen:

- (i) Konflikte in Verbindung mit der Auswahl der Unterdepotbank und Vermögensallokation an mehrere Unterdepotbanken, die beeinflusst werden durch (a) Kostenfaktoren, darunter die geringsten berechneten Gebühren, Gebührenermäßigungen oder ähnliche Anreize, und (b) weitreichende gegenseitige Geschäftsbeziehungen, in denen die Verwahrstelle neben objektiven Bewertungskriterien möglicherweise den wirtschaftlichen Wert der allgemeineren Beziehung als Handlungsgrundlage berücksichtigt;
- (ii) Verbundene und nicht-verbundene Unterdepotbanken handeln für andere Kunden und in ihrem eigenen Eigentümerinteresse, das den Interessen der Kunden entgegenstehen kann;
- (iii) Verbundene und nicht-verbundene Unterdepotbanken haben ausschließlich indirekte Beziehungen mit Kunden und sehen die Verwahrstelle als Gegenpartei an, was für die Verwahrstelle ein Anreiz sein kann, in ihrem Eigeninteresse oder im Interesse anderer Kunden zum Nachteil der Kunden zu handeln; und
- (iv) Unterdepotbanken haben möglicherweise marktbasierende Rechte von Gläubigern gegenüber Kundenvermögen, die sie versuchen durchzusetzen, wenn für Wertpapiergeschäfte nicht bezahlt wird.

Die Verwahrstelle hat bei der Erfüllung ihrer Pflichten ehrlich, redlich, professionell, unabhängig und einzig im Interesse der Gesellschaft und ihrer Anteilhaber zu handeln.

Die Verwahrstelle hat die Ausübung ihrer Verwahraufgaben funktional und hierarchisch von ihren anderen möglicherweise in Konflikt stehenden Aufgaben getrennt. Das System interner Kontrollen, die unterschiedlichen Berichtswege, die Zuweisung von Aufgaben und die Managementberichterstattung ermöglichen die korrekte Identifizierung, Verwaltung und Überwachung potenzieller Interessenkonflikte und Verwahprobleme. Zudem erlegt die Verwahrstelle im Rahmen ihres Einsatzes von Unterdepotbanken vertragliche Beschränkungen auf, um einige potenzielle Konflikte zu behandeln, und behält ihre Sorgfaltspflicht sowie die Aufsicht über Unterdepotbanken bei, um einen hochwertigen Kundenservice seitens dieser Stellen zu gewährleisten. Die Verwahrstelle berichtet zudem regelmäßig über die Tätigkeit und Beteiligungen der Kunden, wobei die zugrunde liegenden Funktionen internen und externen Überwachungsaudits unterliegen. Schließlich trennt die Verwahrstelle intern die Ausübung ihrer depotführenden Aufgaben von ihrer eigenen Geschäftstätigkeit und folgt einem Verhaltensstandard, nach dem Mitarbeiter gegenüber Kunden ethisch, gerecht und transparent handeln müssen.

Aktuelle Informationen zu der Verwahrstelle, ihren Pflichten, möglichen Konflikten, den von der Verwahrstelle übertragenen Verwahraufgaben, der Liste der Beauftragten und Unterbeauftragten und möglichen Interessenkonflikten, die sich aus einer solchen Übertragung ergeben können, werden den Anteilhabern auf Anfrage zur Verfügung gestellt.

### **Abschlussprüfer**

Die Konten und Transaktionen der Gesellschaft sind Gegenstand jährlicher Prüfungshandlungen durch den Abschlussprüfer.

---

## ANLAGEPOLITIK, -ZIELE, -BESCHRÄNKUNGEN UND -TECHNIKEN

---

Das allgemeine Ziel der Gesellschaft ist, ihren Anlegern die größtmögliche Wertsteigerung der angelegten Mittel bei gleichzeitig breiter Streuung der Risiken zu bieten. Dazu investiert die Gesellschaft ihre Vermögenswerte prinzipiell in eine Reihe übertragbarer Wertpapiere, Geldmarktinstrumente, Anteile oder Aktien von OGA, Einlagen bei Kreditinstituten und Derivate, die auf unterschiedliche Währungen lauten und in verschiedenen Ländern ausgegeben werden.

Multi-Management: Dieses Konzept ermöglicht eine Änderung des Untermanagementers des Teilfonds ohne vorherige Mitteilung an die Anteilhaber der Fonds.

Die Anlagepolitik der Gesellschaft wird vom Verwaltungsrat vor dem Hintergrund aktueller politischer, wirtschaftlicher, finanzieller und monetärer Gegebenheiten festgelegt. Die Politik variiert zwischen den verschiedenen Teilfonds innerhalb der Grenzen und in Einklang mit den besonderen Merkmalen und dem Ziel, die für jeden Teilfonds in Teil II des Prospekts angegeben sind.

Die Anlagepolitik wird unter strikter Einhaltung des Prinzips der Diversifizierung und Risikostreuung umgesetzt. Zu diesem Zweck unterliegt die Gesellschaft unbeschadet spezifischer Bestimmungen für einen oder mehrere Teilfonds einer Reihe von Anlagebeschränkungen, die in Anhang 1 festgelegt sind. In diesem Sinne werden die Anleger auf die in Anhang 3 aufgeführten Anlagerisiken hingewiesen.

Jeder Teilfonds fällt in eine Kategorie. Es gibt folgende Kategorien:

### „Single Manager“

Die Verwaltungsgesellschaft kann die Teilfonds direkt verwalten oder an einen externen Anlageverwalter delegieren, der von der Verwaltungsgesellschaft ausgewählt wird, der Anlageentscheidungen im Rahmen der Portfolioverwaltung trifft und gemäß vordefinierter Kriterien ausgewählt wurde, einschließlich:

- einer qualitativen Auswahl (i) durch die Analyse der Stabilität und der Stärke der externen Anlageverwalter sowie ihrer Anlageverfahren und Philosophie; und (ii) durch ein Treffen mit den externen Anlageverwaltungsteams;
- einer quantitativen Auswahl, die darauf abzielt, nur externe Anlageverwalter mit einer nachgewiesenen risikoadjustierten Performance auszuwählen.

Anleger können eine aktualisierte Liste der Untermanagementers beim Sitz der Gesellschaft anfordern.

Weitere Informationen zu Risiken sind in nachstehendem Anhang 3 aufgeführt.

### „Fund of Mandates“, abgekürzt FoM

Die Verwaltungsgesellschaft kann einen Teil der Verwaltung der Teilfonds an mindestens zwei externe Anlageverwalter delegieren, die von der Verwaltungsgesellschaft ausgewählt werden, die Anlageentscheidungen im Rahmen der Portfolioverwaltung treffen und gemäß vordefinierter Kriterien ausgewählt wurden, einschließlich:

- einer qualitativen Auswahl (i) durch die Analyse der Stabilität und der Stärke der externen Anlageverwalter sowie ihrer Anlageverfahren und Philosophie; und (ii) durch ein Treffen mit den externen Anlageverwaltungsteams;
- einer quantitativen Auswahl, die darauf abzielt, nur externe Anlageverwalter mit einer nachgewiesenen risikoadjustierten Performance auszuwählen.

Anleger können eine aktualisierte Liste der Untermanagementers beim Sitz der Gesellschaft anfordern.

Weitere Informationen zu Risiken sind in nachstehendem Anhang 3 aufgeführt.

### „Profile“

Die Verwaltungsgesellschaft darf:

- a) einen Teil der Verwaltung der Teilfonds an mindestens zwei externe Anlageverwalter delegieren, die von der Verwaltungsgesellschaft ausgewählt werden, die Anlageentscheidungen im Rahmen der Portfolioverwaltung treffen.
- b) in Anteile oder Aktien offener Anlagefonds investieren, die die Anforderungen an einen OGAW im Rahmen der Richtlinie 2009/65 und/oder an andere Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne der Richtlinie 2009/65 erfüllen.
- c) die Teilfonds direkt verwalten.

OGAW und Delegierungen werden gemäß den vordefinierten Kriterien ausgewählt, einschließlich:

- einer qualitativen Auswahl (i) durch die Analyse der Stabilität und der Stärke der externen Anlageverwalter sowie ihrer Anlageverfahren und Philosophie; und (ii) durch ein Treffen mit den externen Anlageverwaltungsteams;
- einer quantitativen Auswahl, die darauf abzielt, nur externe Anlageverwalter mit einer nachgewiesenen risikoadjustierten Performance auszuwählen.

Anleger können eine aktualisierte Liste der Untermanagementers beim Sitz der Gesellschaft anfordern.

Die Teilfonds können in Anleihen, Aktien, Geldmärkte über direkte Anlagen, Finanzderivate sowie Organismen für gemeinsame Anlagen (einschließlich börsennotierter Fonds) investieren. Der Schwerpunkt liegt auf einer internationalen Diversifizierung der Anlagen.

### „Fund of Funds“

Der Teilfonds wird in Anteile oder Aktien offener Anlagefonds investieren, die die Anforderungen an einen OGAW im Rahmen der Richtlinie 2009/65 und/oder an andere Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne der Richtlinie 2009/65 erfüllen, die gemäß den vordefinierten Kriterien ausgewählt wurden, einschließlich:

- einer qualitativen Auswahl (i) durch die Analyse der Verwaltungsgesellschaft der Anlagefonds sowie ihrer Anlageverfahren und Philosophie; und (ii) durch ein Treffen mit den Verwaltungsteams;
- einer quantitativen Auswahl, die darauf abzielt, nur diejenigen OGAW und andere OGA mit einer nachgewiesenen risikoadjustierten Performance auszuwählen.

Die Fonds können als Beimischung Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente einschließlich Einlagezertifikaten und kurzfristigen Einlagen halten.

### „Sonstige Fonds“

Diese Teilfonds, die jeweils eigene Risikoprofile und Vermögensallokationen aufweisen, werden aktiv verwaltet durch vorwiegende Anlagen in Anteilen oder Aktien offener Investmentfonds, die die Anforderungen an einen OGAW im Rahmen der Richtlinie 2009/65 und/oder an andere Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne der Richtlinie 2009/65 erfüllen, übertragbaren Aktienwerten und/oder Schuldtiteln oder Kombinationen daraus.

Übertragbare Aktienwerte umfassen im gesetzlich zulässigen Rahmen unter anderem Aktien, Hinterlegungsscheine und -aktien, Wandelanleihen, Index- und Partizipationsscheine. Übertragbare Schuldtitel umfassen unter anderem festverzinsliche Wertpapiere,

hypothekenbesicherte Wertpapiere, Nullkupon-Instrumente, variabel verzinsliche Schuldverschreibungen, Caps, Floors und Collars und sonstige Schuldtitel, einschließlich Schuldtitel mit einer relativ kurzen durchschnittlichen Restlaufzeit, die von Regierungen, Regierungsbehörden, supranationalen Organisationen und Körperschaften ausgegeben oder garantiert werden.

Diese Teilfonds können bei Gelegenheit in nicht notierte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente innerhalb der in Anhang 1 dargelegten Grenzen investieren.

Die Teilfonds können als Beimischung Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente einschließlich Einlagenzertifikaten und kurzfristigen Einlagen halten. Der Verwaltungsrat hat Corporate Governance-Grundsätze eingeführt, die ein Stimmrecht bei den Versammlungen der Gesellschaften beinhalten, in welche die Teilfonds investieren. Die wichtigsten Prinzipien der Abstimmungspolitik des Verwaltungsrats beziehen sich auf die Fähigkeit der Gesellschaft, gegenüber den Anteilhabern für Transparenz und Rechenschaft bezüglich der Anlagen der Anteilhaber zu sorgen, und darauf, dass die Gesellschaft so verwaltet wird, dass Wachstum und Renditen der Anteile langfristig gewährleistet sind. Der Verwaltungsrat setzt die Abstimmungspolitik in gutem Glauben unter Berücksichtigung der besten Interessen der Anteilhaber der Investmentfonds um. Weitere Informationen finden Sie auf der Webseite [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com).

Des Weiteren darf die Gesellschaft Techniken und Instrumente für übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente im Rahmen der in Anhang 2 definierten Bedingungen und Grenzen nutzen, sofern diese Techniken und Instrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements oder zur Erreichung des Anlageziels und/oder zu Liquiditätszwecken und/oder im Falle von ungünstigen Marktbedingungen eingesetzt werden. Wenn bei diesen Geschäften Derivate zum Einsatz kommen, müssen diese Bedingungen und Grenzen den Bestimmungen des Gesetzes entsprechen. Die Gesellschaft darf aufgrund dieser Transaktionen unter keinen Umständen von den im Prospekt beschriebenen Anlagezielen abweichen.

Schließlich kann der Verwaltungsrat zum Zwecke der Senkung der Betriebs- und Verwaltungskosten bei gleichzeitig breiterer Diversifizierung der Anlagen gemäß den Regelungen in Anhang 4 beschließen, die Vermögenswerte der Gesellschaft ganz oder teilweise gemeinsam mit Vermögenswerten, die anderen Organismen für gemeinsame Anlagen gehören, zu verwalten oder die Vermögenswerte eines Teilfonds ganz oder teilweise gemeinsam mit anderen Teilfonds zu verwalten.

Sofern in der Anlagepolitik der einzelnen Teilfonds nichts anderes angegeben ist, kann nicht garantiert werden, dass die Anlageziele der Teilfonds erreicht werden, und die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Indikator für die künftige Wertentwicklung.

## DIE ANTEILE

### ANTEILSKATEGORIEN UND -KLASSEN

Der Verwaltungsrat kann innerhalb jedes Teilfonds die folgenden Anteilskategorien und Anteilsklassen („Kategorien“ und „Klassen“) einrichten:

<i>Kategorie<sup>(4)</sup></i>	<i>Klasse</i>	<i>Namens- anteil</i>	<i>Anleger</i>	<i>Erstzeichnungspreis je Anteil<sup>(1)</sup></i>	<i>Mindestbestand<sup>(2)</sup></i>
Klasse A	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja	Alle	100 EUR 100 USD 100 GBP 1.000 SEK	100 EUR 100 USD 100 GBP 1.000 SEK
Klasse AH EUR	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja		100 EUR	100 EUR
Klasse AH USD	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja		100 USD	100 USD
ABN AMRO Wealth Allocation	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja		100 EUR	100 EUR
ABN AMRO Profifonds A ABN AMRO Profifonds B ABN AMRO Profifonds C	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	100 EUR	100 EUR
Klasse A2	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja	Anleger, die Kunden der Banque Neuflyze OBC oder ihrer verbundenen Unternehmen und zulässige Anleger sind	100 EUR	100 EUR
Klasse A3	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja	Anleger, die Kunden von Aegon oder verbundenen Unternehmen und zulässige Anleger sind	100 EUR	100 EUR
Klasse A4	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja	Anleger, die Kunden von Aegon sind und die Anteilsklasse für Beratungs- und DPM- Aktivitäten und zugelassene Anleger verwenden	100 EUR	100 EUR
Klasse B	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	100 EUR	5.000 EUR
Klasse C	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja		100 EUR 100 USD	5.000 EUR 5.000 USD
Klasse C2	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja		100 EUR 100 USD	5.000 EUR 5.000 USD
Klasse CH EUR	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja		100 EUR	5.000 EUR
Klasse D Klasse DH EUR	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja		Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	100 EUR

<b>Kategorie<sup>(4)</sup></b>	<b>Klasse</b>	<b>Namens- anteil</b>	<b>Anleger</b>	<b>Erstzeichnungspreis je Anteil<sup>(1)</sup></b>	<b>Mindestbestand<sup>(2)</sup></b>	
Klasse E	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung von ABN AMRO und zugelassene Anleger sind	100 EUR	5.000 EUR	
Klasse F	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	100 EUR	5.000 EUR	
Klasse FH EUR						
Klasse G	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe mit einer spezifischen Gebührenvereinbarung und zugelassene Anleger sind	100 EUR	5.000 EUR	
Klasse GH EUR						
Klasse I	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	100 EUR 100 USD 100 GBP 1.000 SEK	1.000.000 EUR 1.000.000 USD 1.000.000 GBP 10.000.000 SEK	
Klasse IH EUR	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja		100 EUR	1.000.000 EUR	
Klasse IH USD	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja		100 USD	1.000.000 USD	
Klasse M	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja		Anleger, die Feeder der Teilfonds der Gesellschaft und zugelassene Anleger sind	100 EUR 100 USD	20.000.000 EUR 20.000.000 USD
Klasse R	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja		Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR 100 USD 100 GBP 1.000 SEK	100 EUR 100 USD 100 GBP 1.000 SEK
Klasse RH EUR	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja		100 EUR 100 USD	100 EUR 100 USD	
Klasse „S“ <sup>(3)(4)</sup>	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja	Zugelassene Anleger	100 EUR 100 USD 100 GBP 1.000 SEK	20.000.000 EUR <sup>(2)</sup> 20.000.000 USD <sup>(2)</sup> 20.000.000 GBP <sup>(2)</sup> 200.000.000 SEK <sup>(2)</sup>	
Klasse X	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja	Institutionelle Anleger und OGA	100 EUR 100 USD 100 GBP 1.000 SEK	20.000.000 EUR <sup>(2)</sup> 20.000.000 USD <sup>(2)</sup> 20.000.000 GBP <sup>(2)</sup> 200.000.000 SEK <sup>(2)</sup>	



<b>Kategorie<sup>(4)</sup></b>	<b>Klasse</b>	<b>Namens- anteil</b>	<b>Anleger</b>	<b>Erstzeichnungspreis je Anteil<sup>(1)</sup></b>	<b>Mindestbestand<sup>(2)</sup></b>
Klasse „Xx“ <sup>(3)(4)</sup>	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja	Zugelassene Anleger	100 EUR 100 USD 100 GBP 1.000 SEK	50.000.000 EUR <sup>(2)</sup> 50.000.000 USD <sup>(2)</sup> 50.000.000 GBP <sup>(2)</sup> 500.000.000 SEK <sup>(2)</sup>
Klasse „XxH EUR“ <sup>(3)(4)</sup>	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja	Zugelassene Anleger	100 EUR	50.000.000 EUR <sup>(2)</sup>
Klasse Z <sup>(3)</sup>	Thesaurierung (THES) Ausschüttung (AUS)	Ja	Zugelassene Anleger	100 EUR 100 USD 100 GBP 1.000 SEK	100.000.000 EUR <sup>(2)</sup> 100.000.000 USD <sup>(2)</sup> 100.000.000 GBP <sup>(2)</sup> 1.000.000.000 SEK <sup>(2)</sup>

(1) Gegebenenfalls ohne Zeichnungsgebühr.

(2) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

(3) Die Klassen „Sx“, „X“ und „Z“ unterliegen besonderen Gebührenvereinbarungen zwischen ihren Anlegern und der Verwaltungsgesellschaft, wobei gleiche Anleger innerhalb derselben Anteilskategorie gleich behandelt werden.

(4) Die Anteilskategorien „Klasse „Sx“ und „Klasse „Xx“ beziehen sich auf einen Oberbegriff für eine unbestimmte Anzahl von Anteilskategorien, die ausgegeben werden können, jeweils bestimmten Anlegern vorbehalten sind und eine spezifische Nummer erhalten (diese wird unmittelbar nach dem oben genannten Namen eingefügt, z. B. „Klasse S1“, „Klasse S2“, „Klasse X1“, „Klasse X2“ usw.). Die verfügbaren Anteilskategorien der „Klasse „S“ und „Klasse „X“ sind auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) angegeben.

Von Zeit zu Zeit können zusätzliche Anteilsklassen in den bestehenden Kategorien aufgelegt werden. Eine Liste aller verfügbaren Anteilsklassen steht auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) zur Verfügung.

### Abgesicherte Kategorien

In einigen Teilfonds können abgesicherte Kategorien aufgelegt werden.

Diese Kategorien unterscheiden sich durch die Absicherung ihrer größten Wechselkursrisiken bezüglich der Rechnungswährung des Teilfonds. Der Manager ist bestrebt, zwischen 80 % und 100 % des Nettovermögens der entsprechenden Kategorie „H“ abzusichern. Bei Veränderungen des Wertes des Portfolios oder im Falle von Zeichnungen und Rücknahmen kann die Absicherungsrate unter 80 % oder über 100 % des Nettovermögens liegen. In einem solchen Fall ist der Manager bestrebt, die Absicherungsrate wieder auf 80 % bis 100 % des Nettovermögens anzupassen. Das Wechselkursrisiko bleibt daher teilweise bestehen, da diese Absicherung nicht das Währungsrisiko aller dem betreffenden Teilfonds zugrunde liegenden Anlagen berücksichtigen kann.

Die Währung dieser Kategorien erscheint in ihrer Bezeichnung (zum Beispiel „AH EUR“, „CH EUR“, „DH EUR“, „EH EUR“ und „IH EUR“ bei einer in EUR abgesicherten Kategorie, wenn die Rechnungswährung des Teilfonds auf USD lautet).

Die Merkmale dieser Kategorien sind identisch mit denen der entsprechenden nicht abgesicherten Kategorien des jeweiligen Teilfonds.

Wenn der Anleger keine spezifischen Anweisungen erteilt, werden eingegangene Aufträge in der Referenzwährung der Kategorie ausgeführt. Die Merkmale dieser Kategorien sind identisch mit denen der entsprechenden nicht abgesicherten Kategorien des jeweiligen Teilfonds.

Diese Kategorien werden zu einem Datum und in Teilfonds aufgelegt, die vom Verwaltungsrat festzulegen sind. Vor der Zeichnung sollten Anleger Informationen zur Auflegung der Kategorien, deren Währungen und den Teilfonds einholen, in denen sie aufgelegt werden.

Wenn die Vermögenswerte einer dieser Kategorien eines Teilfonds den Wert von einer Million Euro oder den entsprechenden Gegenwert unterschreiten, behält sich der Verwaltungsrat das Recht vor, die Kategorie zu schließen und sie mit derselben nicht abgesicherten Kategorie desselben Teilfonds zusammenzulegen.

### Für alle Kategorien geltende allgemeine Bestimmungen

Der Verwaltungsrat kann darüber hinaus jederzeit beschließen, die innerhalb eines Teilfonds, einer Kategorie oder Klasse ausgegebenen Anteile in eine vom Verwaltungsrat selbst festgelegte Anzahl von Anteilen zu teilen oder zusammenzulegen. Der gesamte NIW dieser Anteile muss dem NIW der zum Zeitpunkt der Teilung/Zusammenlegung existierenden geteilten/zusammengelegten Anteile entsprechen.

Vor einer Zeichnung sollte der Anleger in Teil II überprüfen, welche Kategorien und Klassen für jeden Teilfonds zur Verfügung stehen.

Wenn bekannt wird, dass Anteile von anderen als den zugelassenen Personen gehalten werden, werden sie in die entsprechende Kategorie umgetauscht.

Seit der Gründung der Gesellschaft werden Anteile ausschließlich als Namensanteile ausgegeben. Es wurden und werden keine Inhaberanteile ausgegeben.

Das Register der Anteilinhaber wird in Luxemburg von der vorstehend im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ genannten Registerstelle geführt. Sofern nicht anders festgelegt, erhalten Anteilinhaber, deren Anteile als Namensanteile gehalten werden, keine Zertifikate über ihre Anteile. Stattdessen wird ihnen eine Bestätigung ihrer Eintragung in das Register gesendet.

Die Anteile müssen voll eingezahlt sein und werden ohne Nennwert ausgegeben. Sofern nicht anders angegeben, ist ihre Anzahl unbegrenzt. Mit den Anteilen sind die im Luxemburger Gesetz vom 10. August 1915 beschriebenen Rechte verbunden, sofern keine Befreiung durch das Gesetz vorliegt.

Die Anteile können wie vom Verwaltungsrat festgelegt als Bruchteile bis zu einem Hundertstel eines Anteils oder bis zu einem Tausendstel eines Anteils ausgegeben werden.

Alle ganzen Anteile der Gesellschaft haben unabhängig von ihrem Wert die gleichen Stimmrechte. Die Anteile jedes Teilfonds, jeder Kategorie oder Klasse haben gleichermaßen Anspruch auf den Erlös aus der Liquidation eines Teilfonds, einer Kategorie oder Klasse.

Wenn der Anleger keine spezifischen Anweisungen erteilt, werden eingegangene Aufträge in der Referenzwährung der Kategorie ausgeführt.

Vor der Zeichnung sollten Anleger Informationen zur Auflegung der Kategorien, deren Währungen und den Teilfonds einholen, in denen sie aufgelegt werden.

## DIVIDENDEN

Thesaurierende Anteile behalten ihre Erträge ein, um sie wieder anzulegen.

Die Hauptversammlung der Inhaber ausschüttender Anteile jedes betreffenden Teilfonds entscheidet jährlich über den Vorschlag des Verwaltungsrats zur Zahlung einer Dividende, die entsprechend den in Luxemburger Gesetzen und in der Satzung festgelegten Grenzen berechnet wird. In diesem Zusammenhang behält sich die Hauptversammlung das Recht vor, das Nettovermögen der einzelnen Teilfonds der Gesellschaft bis zur Grenze des gesetzlichen Mindestkapitals auszuschütten. Die Art der Ausschüttung (Nettokapitalerträge oder Kapital) wird im Jahresabschluss der Gesellschaft angegeben.

Wenn es unter gegebenen Marktbedingungen nicht im Interesse der Anteilinhaber ist, eine Dividende auszuschütten, wird keine solche Ausschüttung vorgenommen.

Falls der Verwaltungsrat es für zweckmäßig hält, kann er die Ausschüttung von Zwischendividenden beschließen.

Der Verwaltungsrat setzt die Zahlungsmethoden für die beschlossenen Dividenden und Zwischendividenden fest.

Dividenden werden in der Referenzwährung der Klasse gezahlt.

Erklärte Dividenden und Zwischendividenden, die von den Anteilhabern nicht innerhalb von fünf Jahren nach ihrem Zahlungstermin beansprucht werden, verfallen und werden wieder dem betreffenden Teilfonds zugeführt.

Auf erklärte und nicht beanspruchte Dividenden oder Zwischendividenden, welche die Gesellschaft für die Dauer der gesetzlichen Frist im Namen der Anteilinhaber des Teilfonds hält, werden keine Zinsen gezahlt.

## ZEICHNUNG, UMTAUSCH UND RÜCKNAHME VON ANTEILEN

### Vorabinformationen

Zeichnungen, Umtausche und Rücknahmen von Anteilen erfolgen zu einem unbekanntem NIW. Sie können sich auf eine Anzahl von Anteilen oder auf einen Betrag beziehen.

Der Verwaltungsrat behält sich das Recht vor:

- (a) einen Zeichnungs- oder Umtauschantrag aus beliebigem Grund vollständig oder teilweise abzulehnen;
- (b) Anteile, die von Personen ohne Berechtigung zum Kauf oder Besitz von Anteilen der Gesellschaft gehalten werden, jederzeit zurückzunehmen;
- (c) Zeichnungs-, Umtausch- oder Rücknahmeanträge von Anlegern zu verweigern, von denen er annimmt, dass sie Market-Timing und aktives Trading betreiben, und gegebenenfalls die notwendigen Maßnahmen zu ergreifen, um die übrigen Anleger der Gesellschaft zu schützen. Insbesondere kann er eine zusätzliche Rücknahmegebühr von höchstens 2 % des Zeichnungsbetrags erheben, die vom betreffenden Teilfonds einbehalten wird.

Der Verwaltungsrat ist berechtigt, Mindestbeträge für die Zeichnung, den Umtausch, die Rücknahme und den Besitz festzulegen.

Zeichnungen von juristischen Personen, die Zeichnungsanträge einreichen und deren Namen erkennen lassen, dass sie zu ein und derselben Gruppe gehören, oder die ein zentrales Entscheidungsorgan haben, werden zur Berechnung dieser Mindestanlagebeträge zusammengefasst.

Sollte ein Antrag auf Rücknahme oder Umtausch eines Anteils, ein Zusammenlegungs-/Aufteilungsverfahren oder ein anderes Ereignis dazu führen, dass die Anzahl oder der Gesamt-Nettobuchwert der Anteile, die ein Anteilinhaber hält, unter die Anzahl oder den Wert fällt, den der Verwaltungsrat festgelegt hat, kann die Gesellschaft alle Anteile zurücknehmen.

In bestimmten Fällen, die im Abschnitt zur Aussetzung der Berechnung des NIW genannt sind, kann der Verwaltungsrat die Ausgabe, den Umtausch und die Rücknahme von Anteilen sowie die Berechnung ihres NIW vorübergehend aussetzen.

In Verbindung mit Verfahren zur Verhinderung von Geldwäsche muss dem Zeichnungsformular bei einer natürlichen Person eine Personalausweis- oder Passkopie des Zeichners beigefügt sein, die von einer zuständigen Behörde (beispielsweise einer Botschaft, einem Konsulat, Notar, Polizeikommissar) oder von einem Finanzinstitut beglaubigt ist, das Identifizierungsstandards unterliegt, die den in Luxemburg oder satzungsgemäß geltenden gleichwertig sind; bei juristischen Personen ist in folgenden Fällen ein Auszug aus dem Handels- und Gesellschaftsregister erforderlich:

1. direkte Zeichnung von Anteilen der Gesellschaft;
2. Zeichnung über einen professionellen Finanzintermediär, der in einem Land ansässig ist, welches über keine Identifizierungsverpflichtung verfügt, die luxemburgischen Standards bezüglich der Verhinderung der Nutzung des Finanzsystems für Zwecke der Geldwäsche entspricht;
3. Zeichnung über eine Tochtergesellschaft oder Niederlassung, für deren Muttergesellschaft eine Identifizierungspflicht bestehen würde, die der nach Luxemburger Gesetzen erforderlichen gleichwertig ist, wenn das für die Muttergesellschaft geltende Recht diese nicht dazu verpflichtet, die Einhaltung dieser Bestimmungen durch ihre Tochtergesellschaften oder Niederlassungen zu gewährleisten.

Die Gesellschaft ist außerdem verpflichtet, die Herkunft der Mittel zu identifizieren, wenn sie von Finanzinstituten kommen, für die keine mit Luxemburger Gesetzen vergleichbare Identifizierungspflicht besteht. Zeichnungen können vorübergehend bis zur Identifizierung der Mittelherkunft eingefroren werden.

Es wird allgemein davon ausgegangen, dass für Finanzdienstleister mit Sitz in Ländern, die die abschließende Erklärung der FATF (Financial Action Task Force) zur Geldwäsche unterzeichnet haben, eine mit Luxemburger Gesetzen vergleichbare Identifizierungspflicht besteht.

Darüber hinaus unterliegt die Gesellschaft den Vorschriften zur Geldwäsche und Terrorismusfinanzierung (AML/CFT) auf Grundlage der geltenden Luxemburger Gesetze und der verschiedenen Gesetze und Rundschreiben zur Bekämpfung von Geldwäsche und Terrorismusfinanzierung (einschließlich des Gesetzes vom 12. November 2004 in der jeweils gültigen Fassung und von der CSSF veröffentlichten Rundschreiben).

### Verarbeitung personenbezogener Informationen

Mit dem Einreichen eines Zeichnungsantrags ermächtigt der Anleger die Gesellschaft zur Speicherung und Nutzung aller über den Anleger erhaltenen vertraulichen Informationen zur Verwaltung seines Kontos oder für ihre Geschäftsbeziehung. Soweit es diese Nutzung erfordert, stimmt der Anleger auch der Weitergabe dieser Informationen an verschiedene Dienstleister der Gesellschaft zu. Es ist zu beachten, dass bestimmte Dienstleister mit Sitz außerhalb der Europäischen Union möglicherweise weniger strikten Regeln zum Schutz von Daten unterliegen. Die Informationen können zur Archivierung, Auftragsbearbeitung, Beantwortung von Anträgen der Anteilinhaber und zur Versorgung der Anleger mit Informationen zu anderen Produkten und Dienstleistungen der Gesellschaft genutzt werden. Weder die Gesellschaft noch ihre Verwaltungsgesellschaft legen vertrauliche Informationen über Anteilinhaber offen, sofern sie hierzu nicht durch spezifische Vorschriften gezwungen sind.

## Zeichnungen

Die Anteile werden zu einem Preis ausgegeben, der dem NIW pro Anteil entspricht, zuzüglich eines Ausgabeaufschlags, der in Teil II beschrieben ist.

Damit ein Auftrag zum NIW eines bestimmten Bewertungstags ausgeführt wird, muss er spätestens an dem Datum und zu der Uhrzeit bei der Gesellschaft eingehen, die in den besonderen Bedingungen für jeden Teilfonds in Teil II aufgeführt sind. Nach diesem Zeitpunkt eingegangene Aufträge werden zum NIW des nächsten Bewertungstags nach dem betreffenden Bewertungstag ausgeführt.

Um von der Gesellschaft angenommen zu werden, muss der Auftrag alle zur Identifizierung der gezeichneten Anteile und der Identität des Zeichners gemäß vorstehender Beschreibung erforderlichen Informationen enthalten. Aufträge müssen per Post an die Registerstelle gesendet werden. Sie können auch per Fax oder auf elektronischem Weg an die Registerstelle gesendet werden, sofern das Original umgehend per Post nachgesendet wird.

Sofern für einen bestimmten Teilfonds nichts anderes festgelegt ist, ist der Zeichnungspreis für jeden Anteil in einer der Bewertungswährungen der betreffenden Anteile und innerhalb der in Teil II vorgeschriebenen Frist zahlbar, gegebenenfalls zuzüglich der anwendbaren Zeichnungsgebühr. Die Bezahlung der Anteile ist nur per Banküberweisung abzüglich aller Bankgebühren möglich (d.h. auf Kosten des Anlegers). Der Verwaltungsrat behält sich das Recht vor, auf diese Vorschrift zu verzichten und Zahlungen per Scheck zu akzeptieren; der Antrag wird jedoch normalerweise erst bearbeitet, nachdem der Scheck eingelöst wurde. Auf Antrag des Anteilinhabers kann die Zahlung in einer anderen Währung als einer der Bewertungswährungen erfolgen. Dies ist jedoch auf EUR und USD beschränkt. Die Umtauschkosten werden dann vom Anteilinhaber getragen und zum Zeichnungspreis hinzugerechnet. Falls Zahlungen nicht innerhalb der zulässigen Frist eingehen, behält sich der Verwaltungsrat das Recht vor, für jeden Tag des Verzugs Zinsausfälle zum Marktsatz zu fordern.

Die Gesellschaft behält sich vor, Zeichnungsanträge zurückzustellen und/oder zu annullieren, falls ungewiss ist, ob die entsprechende Zahlung innerhalb der bewilligten Zahlungsfristen bei der Verwahrstelle eingehen wird, oder wenn ein Antrag unvollständig ist. Der Verwaltungsrat oder seine Beauftragten können bei der Bearbeitung des Antrags zusätzliche Gebühren zu marktüblichen Sätzen berechnen, um die geschuldeten Zinsen zu berücksichtigen bzw. die Zuteilung von Anteilen stornieren und Ersatz für Verluste aufgrund der nicht fristgerecht erfolgten Zahlung verlangen. Die Anteile werden erst zugeteilt, nachdem der ordnungsgemäß ausgefüllte Zeichnungsantrag zusammen mit der Zahlung oder einem Dokument eingegangen ist, das die fristgerechte Zahlung unwiderruflich garantiert. Wenn die Zahlung durch einen nicht beglaubigten Scheck erfolgt, werden die Anteile nach dem Eingang der Zahlungsbestätigung zugeteilt. Die Gesellschaft kann nicht für eine verzögerte Bearbeitung unvollständiger Aufträge verantwortlich gemacht werden.

Nach der Zeichnung ausstehende Salden werden dem Anteilinhaber erstattet, sofern der Betrag über 15 EUR bzw. über dem entsprechenden Gegenwert in einer anderen Währung liegt. Nicht erstattete Beträge fließen dem betreffenden Teilfonds zu.

Der Verwaltungsrat kann die Ausgabe von Anteilen gegen Einbringung von übertragbaren Wertpapieren in natura gestatten. Hierfür gelten die nach Luxemburger Gesetzen festgelegten Bedingungen, insbesondere hinsichtlich der Verpflichtung zur Beschaffung eines Bewertungsgutachtens seitens des vorstehend im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ erwähnten Abschlussprüfers, vorausgesetzt, dass diese übertragbaren Wertpapiere der Anlagepolitik der Gesellschaft und den Anlagebeschränkungen des betreffenden Teilfonds entsprechen, wie diese in Teil II beschrieben werden. Sofern nicht anders angegeben, werden die Kosten einer solchen Transaktion vom Antragsteller getragen.

## Umtausch

Unbeschadet der speziellen Bestimmungen eines Teilfonds, einer Kategorie oder einer Klasse können Anteilinhaber den Umtausch eines Teils oder all ihrer Anteile in Anteile eines anderen Teilfonds, einer anderen Kategorie oder einer anderen Klasse beantragen, jedoch vorbehaltlich der Bedingungen für die Zulässigkeit von Anlegern, die für die einzelnen Klassen dargelegt sind, wie unter „Anteilkategorien und Klassen“ in Teil I näher beschrieben. Die Anzahl der neu ausgegebenen Anteile und die aus der Transaktion entstehenden Kosten werden gemäß der nachfolgend beschriebenen Formel berechnet.

Damit ein Umtauschauftrag zum NIW eines bestimmten Bewertungstags ausgeführt wird, muss er von der Gesellschaft spätestens an dem Datum und zu der Uhrzeit angenommen werden, die für jeden Teilfonds in Teil II aufgeführt sind. Nach diesem Zeitpunkt eingegangene Aufträge werden zum NIW des nächsten Bewertungstags ausgeführt.

## Umtauschformel

Die Anzahl der einer neuen Kategorie zugeteilten Anteile wird nach der folgenden Formel ermittelt:

$$A = [(B \times (C - (C \times F)) \times D) / E] + X$$

wobei

- „A“ die Anzahl der Anteile ist, die der neuen Kategorie zuzuteilen sind;
- „B“ die Anzahl der Anteile ist, die aus der ursprünglichen Kategorie umzutauschen sind;
- „C“ der NIW der umzutauschenden Anteile der ursprünglichen Kategorie am entsprechenden Bewertungstag ist;
- „D“ der am Tag der Transaktion zwischen den Währungen der umzutauschenden Anteile anwendbare Umtauschkurs ist;
- „E“ der NIW der Anteile am entsprechenden Bewertungstag ist, die der neuen Kategorie zuzuteilen sind;
- „F“ der Provisionssatz für einen Umtausch entsprechend der Beschreibung jedes Teilfonds in Teil II ist;
- „X“ der nicht zugeteilte Saldo ist, der dem Anteilinhaber gegebenenfalls erstattet wird. Anleger werden daran erinnert, dass die Gesellschaft wie vom Verwaltungsrat festgelegt Anteilsbruchteile bis zu einem Hundertstel oder bis zu einem Tausendstel ausgeben kann.

## Rücknahmen

Vorbehaltlich der im Prospekt beschriebenen Ausnahmen und Beschränkungen haben alle Anteilinhaber jederzeit Anspruch auf die Rücknahme der Anteile durch die Gesellschaft.

Damit ein Auftrag zum NIW eines bestimmten Bewertungstags ausgeführt wird, muss er von der Gesellschaft spätestens an dem Datum und zu der Uhrzeit angenommen werden, die in den Bedingungen für jeden Teilfonds in Teil II aufgeführt sind. Nach diesem Zeitpunkt eingegangene Aufträge werden zum NIW des nächsten Bewertungstags ausgeführt.

Um von der Gesellschaft angenommen zu werden, muss der Auftrag alle zur Identifizierung der betreffenden Anteile und der Identität des Anteilinhabers gemäß vorstehender Beschreibung erforderlichen Informationen enthalten.

Sofern für einen bestimmten Teilfonds nichts anderes festgelegt ist, wird der Rücknahmebetrag für jeden Anteil in einer der Bewertungswährungen der betreffenden Anteile und innerhalb der in Teil II vorgeschriebenen Frist erstattet, gegebenenfalls abzüglich der anwendbaren Rücknahmeprovision.

Auf Antrag des Anteilinhabers kann die Zahlung auch in einer anderen Währung als der Bewertungswährung der zurückgegebenen Anteile erfolgen. Dies ist jedoch auf EUR und USD beschränkt. In diesem Fall hat der Anteilinhaber die Umtauschkosten zu tragen, die mit dem Rücknahmepreis verrechnet werden. Der Rücknahmepreis von Anteilen kann höher oder niedriger sein als der Preis, der zum

Zeitpunkt der Zeichnung (oder des Umtauschs) gezahlt wurde. Dies hängt davon ab, ob sich der NIW in dem Zeitraum erhöht oder verringert hat.

Die Gesellschaft behält sich das Recht vor, Rücknahmeanträge aufzuschieben, wenn der Auftrag unvollständig ist. Die Gesellschaft kann nicht für eine verzögerte Bearbeitung unvollständiger Aufträge verantwortlich gemacht werden.

Rücknahmen in Sachwerten sind mit besonderer Genehmigung des Verwaltungsrats möglich, sofern die verbleibenden Anteilhaber nicht berührt sind und ein Bewertungsbericht vom Abschlussprüfer erstellt wird. Die Art oder der Typ der in diesen Fällen zu übertragenden Vermögenswerte wird vom Anlageverwalter unter Einhaltung der Anlagepolitik und -beschränkungen des betreffenden Teilfonds festgelegt. Die Kosten für solche Transaktionen hat möglicherweise der Antragsteller zu tragen.

Falls die Rücknahme-/Umtauschanträge, die für einen Teilfonds an einem bestimmten Bewertungstag eingehen, 10 % des Nettovermögens des betreffenden Teilfonds übersteigen, kann der Verwaltungsrat beschließen, diese Rücknahme-/Umtauschanträge anteilig zu reduzieren und/oder zurückzustellen, um die Zahl der an diesem Bewertungstag zurückgenommenen/umgetauschten Anteile auf 10 % des Nettovermögens des betreffenden Teilfonds zu senken. Zurückgestellte Rücknahme-/Umtauschanträge haben Vorrang vor Rücknahme-/Umtauschanträgen, die am nächsten Bewertungstag eingehen, wobei erneut die Grenze von 10 % des Nettovermögens gilt.

#### **Börsennotierung**

Auf Beschluss des Verwaltungsrats können die Anteile der Teilfonds und der Kategorien der Gesellschaft zur offiziellen Notierung an der Luxemburger Wertpapierbörse und/oder gegebenenfalls an anderen Wertpapierbörsen zugelassen werden.

**BERECHNUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL**

Jede Berechnung des NIW wird folgendermaßen unter Verantwortung des Verwaltungsrats durchgeführt:

1. Die Berechnung des NIW erfolgt gemäß den in Teil II genannten Bedingungen.
2. Die Berechnung des NIW je Anteil erfolgt anhand des gesamten Nettovermögens des betreffenden Teilfonds, der betreffenden Kategorie oder der betreffenden Klasse. Das gesamte Nettovermögen jedes Teilfonds, jeder Kategorie oder jeder Klasse wird berechnet, indem sämtliche jeweils gehaltenen Vermögenswerte (einschließlich der Ansprüche oder prozentualen Anteile an bestimmten internen Unterportfolios, wie im Einzelnen nachstehend unter Ziffer 4 beschrieben) addiert und die jeweiligen Verbindlichkeiten oder Verpflichtungen davon abgezogen werden (unter Beachtung der Bestimmungen der nachstehenden Ziffer 4 Absatz 4).
3. Der NIW je Anteil der einzelnen Teilfonds, Kategorien oder Klassen wird berechnet, indem die jeweilige Summe des Nettovermögens durch die Anzahl der sich in Umlauf befindenden Anteile, wie vom Verwaltungsrat für jeden Teilfonds festgelegt gerundet auf bis zu zwei oder drei Dezimalstellen, dividiert wird. Dies gilt nicht für Währungen, die keine Dezimalstellen verwenden.
4. Um das gesamte finanzielle Management und die Verwaltung von Gruppen von Vermögenswerten, die zu einem oder mehreren Teilfonds, Kategorien und Klassen gehören, intern zu ermöglichen, kann der Verwaltungsrat so viele interne Unterportfolios bilden, wie es zu verwaltende Gruppen von Vermögenswerten gibt (die „internen Unterportfolios“).

So können ein oder mehrere Teilfonds, Kategorien oder Klassen mit vollständig oder teilweise identischer Anlagepolitik die jeweils von ihnen erworbenen Vermögenswerte im Rahmen der Umsetzung dieser Anlagepolitik in einem zu diesem Zweck gebildeten internen Unterportfolio zusammenfassen. Der von jedem Teilfonds, jeder Kategorie oder Klasse innerhalb jedes dieser internen Unterportfolios gehaltene Anteil kann entweder durch einen Prozentsatz oder in Form von Ansprüchen entsprechend den Angaben in den beiden folgenden Absätzen ausgedrückt werden. Die Einrichtung eines internen Unterportfolios dient ausschließlich dazu, die finanzielle und administrative Verwaltung der Gesellschaft zu erleichtern.

Die Besitzverhältnisse werden ausschließlich auf der Basis des Einlageverhältnisses der Vermögenswerte eines bestimmten internen Unterportfolios berechnet. Die Prozentsätze dieser Anteile werden an jedem Bewertungstag neu berechnet, um Rücknahmen, Ausgaben, Umtauschvorgänge, Ausschüttungen oder sonstige Ereignisse allgemeiner Art zu berücksichtigen, die sich auf einen der betreffenden Teilfonds, eine Kategorie oder Klasse auswirken und deren Anteil am betreffenden internen Unterportfolio steigen oder sinken lassen können.

Die von einem bestimmten internen Unterportfolio ausgehenden Ansprüche werden ebenso regelmäßig und häufig und gemäß denselben Modalitäten bewertet, wie unter den vorstehenden Ziffern 1, 2 und 3 beschrieben. Die Gesamtzahl der ausgehenden Ansprüche verändert sich entsprechend den Ausschüttungen, Rücknahmen, Ausgaben, Umtauschvorgängen oder sonstigen Ereignissen allgemeiner Art, die sich auf einen der betreffenden Teilfonds, eine Kategorie oder Klasse auswirken und deren Anteil am betreffenden internen Unterportfolio steigen oder sinken lassen können.

5. Unabhängig von der Anzahl der innerhalb eines bestimmten Teilfonds gebildeten Kategorien oder Klassen ist das gesamte Nettovermögen dieses Teilfonds mit nach Luxemburger Recht, in der Satzung oder im Prospekt festgelegten Häufigkeit zu berechnen. Das gesamte Nettovermögen jedes Teilfonds wird durch Addition des Nettovermögens jeder innerhalb dieses Teilfonds gebildeten Kategorie oder Klasse berechnet.
6. Unbeschadet der Informationen unter vorstehender Ziffer 4 hinsichtlich der Ansprüche und der prozentualen Anteile und unbeschadet der besonderen Regeln, die möglicherweise für einen oder mehrere bestimmte Teilfonds festgelegt sind, erfolgt die Bewertung des Nettovermögens der verschiedenen Teilfonds gemäß den nachstehenden Regeln.

**ZUSAMMENSETZUNG DER VERMÖGENSWERTE**

Die Vermögenswerte der Gesellschaft umfassen in erster Linie:

- (1) Kassenbestände und Bardepots einschließlich aufgelaufener und noch ausstehender Zinsen und bis zum Zahlungsdatum aufgelaufener Zinsen;
- (2) alle bei Sicht fälligen Schuldverschreibungen und Wechsel sowie Forderungen (einschließlich noch nicht erhaltener Erlöse aus Wertpapierverkäufen);
- (3) alle Wertpapiere, Anteile, Beteiligungen, Anleihen, Optionen oder Vorzugsrechte für die Zeichnung und sonstigen Anlagen und Wertpapiere im Besitz der Gesellschaft;
- (4) alle Dividenden und Ausschüttungen, die der Gesellschaft in bar oder in Form von Wertpapieren zustehen oder von denen die Gesellschaft Kenntnis hat;
- (5) alle aufgelaufenen, jedoch noch nicht vereinnahmten Zinsen und alle bis zum Zahlungsdatum von sich im Besitz der Gesellschaft befindlichen Wertpapieren generierten Zinsen, sofern diese Zinsen nicht im Kapital dieser Wertpapiere enthalten sind;
- (6) die Gründungskosten der Gesellschaft, wenn sie noch nicht abgeschrieben wurden;
- (7) sämtliche anderen Vermögenswerte jeglicher Art einschließlich Rechnungsabgrenzungsposten.

**BEWERTUNGSREGELN**

Die Vermögenswerte jedes Teilfonds werden wie folgt bewertet:

- (1) Der Wert von Kassenbeständen und Bardepots, bei Sicht fälligen Wechseln und Schuldverschreibungen, Forderungen, Rechnungsabgrenzungsposten, Dividenden und ausgewiesenen oder fälligen, jedoch noch nicht vereinnahmten Zinsen wird zum Nennwert dieser Vermögenswerte bewertet, außer es erweist sich als unwahrscheinlich, dass dieser Wert erzielt werden kann. In diesem Fall wird der Wert durch Abzug eines Betrags ermittelt, den die Gesellschaft für angemessen erachtet, den Realwert dieser Vermögenswerte wiederzugeben;
- (2) Der Wert von Aktien oder Anteilen von Organismen für gemeinsame Anlagen wird auf der Grundlage des letzten am Bewertungstag verfügbaren NIW ermittelt;
- (3) Die Bewertung aller Wertpapiere, die an einer Börse oder an einem anderen geregelten, ordnungsgemäß funktionierenden, anerkannten und der Öffentlichkeit zugänglichen Markt gehandelt werden, erfolgt anhand des Schlusskurses am Tag der Auftragsannahme. Bei Wertpapieren, die an mehreren Märkten gehandelt werden, erfolgt die Bewertung auf Grundlage des aktuell am Hauptmarkt dieser Wertpapiere geltenden Kurses. Falls dieser Kurs nicht repräsentativ ist, erfolgt die Bewertung auf Grundlage des wahrscheinlichen Realisierungswerts, den der Verwaltungsrat mit der gebotenen Sorgfalt und nach Treu und Glauben schätzt;
- (4) Nicht notierte Wertpapiere oder nicht an einer Börse oder einem anderen geregelten, ordnungsgemäß funktionierenden, anerkannten und der Öffentlichkeit zugänglichen Markt gehandelte Wertpapiere werden auf der Grundlage des wahrscheinlichen Verkaufspreises bewertet, der umsichtig und in gutem Glauben von einem hierzu vom Verwaltungsrat ernannten Sachverständigen geschätzt wird;

- (5) Wertpapiere, die auf eine andere Währung lauten als diejenige des betreffenden Teilfonds, werden auf Grundlage ihres am Bewertungstag geltenden Wechselkurses umgerechnet;
- (6) Wenn die Marktpraxis es zulässt, können liquide Vermögenswerte, Geldmarktinstrumente und alle sonstigen Instrumente mit ihrem Nominalwert zuzüglich der aufgelaufenen Zinsen oder mittels der linearen Abschreibungsmethode bewertet werden. Gemäß den im Februar 2009 verabschiedeten Leitlinien der Association of the Luxembourg Fund Industry (ALFI) zur Berechnung der fortgeführten Anschaffungskosten gegenüber der Marktwertabweichung für Fonds, die eine solche Bewertung gemäß ihrem Prospekt erfordern, bedarf jeder Beschluss, die Vermögenswerte des Portfolios unter Verwendung der linearen Abschreibungsmethode zu bewerten, der Genehmigung durch den Verwaltungsrat, der die Gründe für diesen Beschluss dokumentieren muss. Der Verwaltungsrat richtet angemessene Prüfungen und Kontrollen für die Bewertung der Instrumente ein;
- (7) Der Verwaltungsrat ist befugt, die Regeln für die entsprechenden Wertansätze aufzustellen oder zu ändern. Beschlüsse, die in diesem Zusammenhang gefasst wurden, werden in Teil II aufgenommen;
- (8) IRS werden auf der Grundlage der Differenz zwischen dem Wert aller von der Gesellschaft zukünftig an ihre Gegenpartei zu zahlenden Zinsen an dem Bewertungstag zum Nullkupon-Swapsatz entsprechend der Fälligkeit dieser Zahlungen und dem Wert aller an die Gesellschaft zukünftig von der Gegenpartei zu zahlenden Zinsen an dem Bewertungstag zum Nullkupon-Swapsatz entsprechend der Fälligkeit dieser Zahlungen bewertet;
- (9) In das interne Bewertungsmodell für CDS fließen zur Berechnung des Marktwertes die CDS-Kurve, die Verwertungsrate und ein Diskontsatz (LIBOR oder Swap zum Marktwert) ein. Dieses interne Bewertungsmodell liefert auch die Zinskurve für die Wahrscheinlichkeiten von Zahlungsausfällen. Zur Bildung der CDS-Kurve werden Daten einer bestimmten Anzahl an Gegenparteien verwendet, die auf dem CDS-Markt aktiv sind. Der Manager verwendet die Bewertung der CDS der Gegenparteien, um sie mit den aus dem internen Modell erhaltenen Werten zu vergleichen. Als Ausgangspunkt für die Schaffung des internen Modells dient eine Korrelation zwischen dem variablen und dem festverzinslichen Anteil der CDS zum Zeitpunkt der Zeichnung der CDS.
- (10) Da EDS von einem Ereignis ausgelöst werden, das eine Aktie betrifft, hängt ihre Bewertung hauptsächlich von der Volatilität der Aktie und ihrer asymmetrischen Position ab. Je höher die Volatilität, desto größer das Risiko, dass die Aktie die Schwelle von 70 % erreicht, und damit desto größer die EDS-Spanne. Die Spanne der CDS einer Gesellschaft spiegelt auch ihre Volatilität wider, da eine hohe Volatilität der Anteile darauf hinweist, dass für die Vermögenswerte der Gesellschaft eine hohe Volatilität und somit auch die hohe Wahrscheinlichkeit eines Kreditereignisses bestehen. Da die Spannen sowohl für EDS als auch CDS mit der impliziten Volatilität der Anteile zusammenhängen und diese Zusammenhänge dazu tendieren, im Laufe der Zeit stabil zu bleiben, kann ein EDS als stellvertretend für einen CDS angesehen werden. Der wichtigste Punkt bei der Bewertung eines EDS ist die Berechnung der impliziten Wahrscheinlichkeit eines Aktienereignisses. Allgemein werden zwei Methoden akzeptiert: Erstens, die Nutzung der Marktspanne des CDS als Input für ein Modell zur Berechnung des EDS; zweitens, die Nutzung historischer Daten des betreffenden Anteils, um die Wahrscheinlichkeit einzuschätzen. Obwohl historische Daten kein verlässlicher Hinweis für zukünftige Entwicklungen sind, können diese Daten das allgemeine Verhalten eines Anteils im Falle einer Krise widerspiegeln. Vergleicht man die beiden Ansätze, so liegen die historischen Wahrscheinlichkeiten selten höher als die impliziten Wahrscheinlichkeiten der Anteile;

## ZUSAMMENSETZUNG DER VERBINDLICHKEITEN

Die Verbindlichkeiten der Gesellschaft umfassen in erster Linie:

- (1) alle Darlehen, fälligen Wechsel und Verbindlichkeiten;
- (2) alle bekannten fälligen und nicht fälligen Verbindlichkeiten, einschließlich aller fälligen vertraglichen Verpflichtungen und im Zusammenhang mit Zahlungen in bar oder in Sachanlagen, einschließlich von der Gesellschaft erklärter, aber noch nicht gezahlter Dividendenbeträge;
- (3) alle vom Verwaltungsrat bewilligten oder genehmigten Rücklagen einschließlich Rücklagen, die zur Deckung eines potenziellen Kapitalverlustes bei bestimmten Anlagen der Gesellschaft gebildet werden;
- (4) sonstige von der Gesellschaft eingegangene Verpflichtungen mit Ausnahme der durch das Eigenkapital der Gesellschaft repräsentierten Verpflichtungen. Zur Bewertung der Höhe dieser Verbindlichkeiten berücksichtigt die Gesellschaft alle Gebühren, für die sie haftet, einschließlich und ohne Einschränkung der Kosten von Änderungen der Satzung, des Prospekts und sonstiger die Gesellschaft betreffender Dokumente, Verwaltungs-, Erfolgs- und sonstiger Gebühren und außergewöhnlicher Aufwendungen, Steuern und Abgaben an Regierungsstellen und Börsen, finanzieller Belastungen sowie Bank- oder Maklergebühren, die beim Kauf und Verkauf von Vermögenswerten oder anderweitig entstanden sind. Zur Bewertung der Höhe dieser Verbindlichkeiten berücksichtigt die Gesellschaft regelmäßige und wiederkehrende Verwaltungs- und sonstige Ausgaben auf einer zeitanteiligen Basis.

Die Vermögenswerte, Verpflichtungen, Ausgaben und Gebühren, die nicht einem bestimmten Teilfonds, einer bestimmten Kategorie oder Klasse zuzuordnen sind, werden den verschiedenen Teilfonds, Kategorien oder Klassen zu gleichen Teilen oder, soweit die fraglichen Beträge dies rechtfertigen, im Verhältnis zu ihrem jeweiligen Nettovermögen zugerechnet. Jeder Anteil der Gesellschaft in der Rücknahmephase wird bis zum Geschäftsschluss an dem Bewertungstag, an dem die Rücknahme antragsgemäß erfolgen soll, als ausgegebener und vorhandener Anteil betrachtet, und sein Preis wird ab dem Geschäftsschluss des betreffenden Datums bis zu seiner ordnungsgemäßen Bezahlung als eine Verbindlichkeit der Gesellschaft betrachtet. Jeder von der Gesellschaft gemäß eingegangenen Zeichnungsanträgen auszugebende Anteil wird als ein der Gesellschaft geschuldeter Betrag behandelt, bis er ordnungsgemäß bei der Gesellschaft eingegangen ist. Soweit möglich, wird jegliche von der Gesellschaft bis zum Bewertungstag beschlossene Anlage oder Auflösung einer Anlage berücksichtigt.

## AUSSETZUNG DER BERECHNUNG DES NETTOINVENTARWERTS SOWIE DER AUSGABE, DES UMTAUSCHS UND DER RÜCKNAHME VON ANTEILEN

Unbeschadet der Rechtsgründe für eine Aussetzung ist der Verwaltungsrat ermächtigt, in den folgenden Fällen die Berechnung des NIW der Anteile eines oder mehrerer Teilfonds sowie die Ausgabe, den Umtausch und die Rücknahme zeitweilig mit sofortiger Wirkung auszusetzen:

- (a) während der Zeit, in der ein oder mehrere Devisenmärkte oder eine Wertpapierbörse, an denen ein wesentlicher Teil der Anlagen eines Teilfonds notiert ist oder gehandelt wird, außerhalb von regulären Ruhetagen geschlossen sind oder der Handel an dieser Börse oder auf diesem Markt erheblich eingeschränkt ist oder ausgesetzt wurde;
- (b) wenn die politische, wirtschaftliche, militärische, Währungs- oder soziale Situation oder ein Ereignis *höherer Gewalt* außerhalb der Verantwortung oder des Einflusses der Gesellschaft es unmöglich macht, Vermögenswerte auf vernünftige und normale Weise zu veräußern, ohne den Interessen der Anteilinhaber erheblich zu schaden;
- (c) während eines Ausfalls der Kommunikationsmittel, die üblicherweise für die Bestimmung des Preises von Anlagen der Gesellschaft oder des aktuellen Preises auf einem bestimmten Markt oder an einer bestimmten Börse verwendet werden;
- (d) wenn Devisen- oder Kapitalverkehrsbeschränkungen die Ausführung einer Transaktionen im Auftrag der Gesellschaft verhindern oder wenn Käufe und Verkäufe der Vermögenswerte der Gesellschaft nicht zu normalen Umtauschkursen ausgeführt werden können;
- (e) sobald die Auflösung der Gesellschaft oder eines oder mehrerer Teilfonds, von Kategorien oder Klassen beschlossen wird;

- (f) um im Rahmen der Verschmelzung, Einbringung, Teilung oder Restrukturierung eines oder mehrerer Teilfonds, von Kategorien oder Klassen den Paritätskurs zu ermitteln;
- (g) für einen „Feeder“-Teilfonds, wenn die Berechnung des NIW, die Ausgabe, der Umtausch oder die Rücknahme von Anteilen des „Master“-Teilfonds ausgesetzt wird;
- (h) in allen sonstigen Fällen, wenn der Verwaltungsrat zu der begründeten Entscheidung gelangt, dass eine solche Aussetzung zur Wahrung der allgemeinen Interessen der betroffenen Anteilinhaber erforderlich ist.

Bei einer Aussetzung der Berechnung des NIW informiert die Gesellschaft unverzüglich und in angemessener Weise die Anteilinhaber, die die Zeichnung, den Umtausch oder die Rücknahme von Anteilen betroffener Teilfonds beantragt haben.

Unter außergewöhnlichen Umständen, die sich nachteilig auf die Interessen der Anteilinhaber auswirken können, oder bei Vorliegen von Zeichnungs-, Rücknahme- oder Umtauschanträgen von mehr als 10 % des Nettovermögens eines Teilfonds behält sich der Verwaltungsrat das Recht vor, den Wert eines Anteils erst festzulegen, nachdem er für Rechnung des Teilfonds die erforderlichen Käufe und Verkäufe von Wertpapieren vorgenommen hat. In diesem Fall werden vorhandene Zeichnungs-, Rücknahme- oder Umtauschanträge von Anteilen auf der Grundlage des auf diese Weise berechneten NIW bearbeitet.

Noch ausstehende Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge können schriftlich zurückgezogen werden, sofern die entsprechende Benachrichtigung vor Ende der Aussetzung bei der Gesellschaft eingeht. Ausstehende Anträge werden am ersten Bewertungstag nach dem Ende der Aussetzung berücksichtigt. Wenn nicht alle ausstehenden Anträge an demselben Bewertungstag bearbeitet werden können, haben die frühesten Anträge Vorrang vor späteren Anträgen.

## SWING-PRICING

Unter bestimmten Umständen können Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschvorgänge bei einem Teilfonds negative Auswirkungen auf den Nettoinventarwert je Anteil haben. Wenn Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschvorgänge bei einem Teilfonds dazu führen, dass dieser zugrunde liegende Anlagen kaufen und/oder verkaufen muss, kann der Wert dieser Anlagen durch Geld-Brief-Spannen, Handelskosten und ähnliche Aufwendungen, unter anderem Transaktionsgebühren, Maklergebühren und Steuern, beeinträchtigt werden. Diese Anlageaktivität kann eine negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert je Anteil haben, die man als „Verwässerung“ bezeichnet. Um die bestehenden oder verbleibenden Anleger vor den möglichen Auswirkungen einer Verwässerung zu schützen, kann der Teilfonds eine Swing-Pricing-Anpassung bezüglich der Kapitalaktivität vornehmen, die auf der Ebene des Teilfonds erfolgt und nicht die spezifischen Umstände der Transaktionen der einzelnen Anleger betrifft, wie nachfolgend ausführlicher beschrieben.

Sofern in der maßgeblichen Teilfondsbeschreibung in Teil II nicht anders angegeben, kann eine Swing-Pricing-Anpassung auf den Preis aufgeschlagen werden, zu dem Anteile ausgegeben werden, falls die Netto-Zeichnungsanträge einen bestimmten Schwellenwert übersteigen, der jeweils durch den Verwaltungsrat festgelegt wird (der sogenannte Swing-Pricing-Schwellenwert), und von dem Preis abgezogen werden, zu dem Anteile zurückgenommen werden, falls die Netto-Rücknahmeanträge einen bestimmten Schwellenwert übersteigen, den der Verwaltungsrat jeweils festlegt.

Die Swing-Pricing-Anpassung besteht darin, den Nettoinventarwert je Anteil anzupassen, um die Gesamtkosten für den Kauf und/oder Verkauf zugrunde liegender Anlagen zu berücksichtigen. Der Nettoinventarwert je Anteil wird um einen bestimmten Prozentsatz angepasst, der jeweils vom Verwaltungsrat für jeden Teilfonds festgelegt wird – den sogenannten „Swing-Faktor“, der den geschätzten Geld-/Briefkurs-Spread der Vermögenswerte darstellt, in die der Teilfonds investiert, und die geschätzten Steuern, Handelskosten und ähnlichen Aufwendungen, die dem Teilfonds durch den Kauf und/oder Verkauf der zugrunde liegenden Anlagen entstehen können. Da einige Aktienmärkte und Länder unterschiedliche Gebührenstrukturen auf der Kauf- und der Verkaufsseite haben können, kann der Swing-Faktor für Nettozeichnungen und Nettorücknahmen eines Teilfonds unterschiedlich sein. Im Allgemeinen wird der Swing-Faktor zwei Prozent (2 %) des Nettoinventarwerts je Anteil nicht übersteigen. Dennoch könnte der maximale Swing-Faktor unter außergewöhnlichen Umständen, wie politischen, militärischen, wirtschaftlichen, finanziellen, geldpolitischen, gesundheitlichen oder sonstigen Notlagen außerhalb der Kontrolle, der Verantwortlichkeit und des Einflusses der Verwaltungsgesellschaft, vorübergehend über den vorstehend genannten Maximalprozentsatz angehoben werden. Der geltende Swing-Faktor für einen spezifischen Teilfonds ist auf Anfrage bei der Verwaltungsgesellschaft verfügbar. Die Angemessenheit des Swing-Faktors im Hinblick auf die Marktbedingungen wird regelmäßig überprüft.

Der Verwaltungsrat legt fest, ob ein teilweiser oder vollständiger „Swing“ vorgenommen wird. Wenn ein teilweiser „Swing“ vorgenommen wird, wird der Nettoinventarwert je Anteil nach oben oder unten angepasst, falls die Nettozeichnungen oder -rücknahmen eines Teilfonds einen bestimmten Schwellenwert überschreiten, der vom Verwaltungsrat jeweils für jeden Teilfonds festgelegt wird (der sogenannte „Swing-Schwellenwert“). Wenn ein vollständiger „Swing“ vorgenommen wird, gibt es keinen Swing-Schwellenwert. Der Swing-Faktor wird die folgenden Auswirkungen auf Zeichnungen oder Rücknahmen haben:

- 1) Bei einem Teilfonds, der an einem Bewertungstag Nettozeichnungen aufweist (d. h. der Wert der Zeichnungen übersteigt jenen der Rücknahmen) (über dem Swing-Schwellenwert, soweit zutreffend), wird der Nettoinventarwert je Anteil durch den Swing-Faktor nach oben angepasst; und
- 2) bei einem Teilfonds, der an einem Bewertungstag Nettorücknahmen aufweist (d. h. der Wert der Rücknahmen übersteigt jenen der Zeichnungen) (über dem Swing-Schwellenwert, soweit zutreffend), wird der Nettoinventarwert je Anteil durch den Swing-Faktor nach unten angepasst.

Die Volatilität des Nettoinventarwerts des Teilfonds spiegelt aufgrund der Anwendung von Swing Pricing gegebenenfalls nicht die tatsächliche Portfolioperformance wider (und kann daher vom Benchmarkindex des Teilfonds abweichen, sofern vorhanden). Die gegebenenfalls vorgesehene Erfolgsgebühr wird auf der Grundlage des Nettoinventarwerts des Teilfonds ohne Berücksichtigung des Swing-Pricings erhoben.

**BESTEuerung DER GESELLSCHAFT**

Zum Datum des Prospekts unterliegt die Gesellschaft keiner Einkommen-, Kapitalertrags- oder Vermögenssteuer in Luxemburg.

Die Gesellschaft unterliegt einer jährlichen *Taxe d'Abonnement* in Luxemburg in Höhe von 0,05 % des NIW. Dieser Satz wird auf 0,01 % reduziert für:

- a) Teilfonds, deren ausschließlicher Zweck die gemeinsame Anlage in Geldmarktinstrumenten und in Einlagen bei Kreditinstituten ist;
- b) Teilfonds, deren ausschließlicher Zweck die gemeinsame Anlage in Einlagen bei Kreditinstituten ist;
- c) Teilfonds, Kategorien oder Klassen, die institutionellen Anlegern und/oder Fondsmanagern und/oder OGA vorbehalten sind.

Die folgenden Positionen sind von dieser *Taxe d'Abonnement* befreit:

- a) der Wert von Vermögenswerten, die durch Aktien oder Anteile anderer OGA repräsentiert werden, sofern die *Taxe d'Abonnement* für diese Anteile oder Aktien bereits erhoben wurde;
- b) Teilfonds, Kategorien und/oder Klassen:
  - (i) deren Wertpapiere institutionellen Anlegern vorbehalten sind; und
  - (ii) deren einziger Zweck die gemeinsame Anlage in Geldmarktinstrumenten und in Einlagen bei Kreditinstituten ist; und
  - (iii) deren gewichtete verbleibende Portfoliofälligkeit höchstens 90 Tage beträgt, und
  - (iv) die das höchstmögliche von einer anerkannten Ratingagentur vergebene Rating erhalten haben.Existieren mehrere Anteilskategorien innerhalb des Teilfonds, gilt die Befreiung nur für die institutionellen Anlegern vorbehaltenen Anteilskategorien.
- c) Teilfonds, Kategorien und/oder Klassen, die folgenden Anlegern vorbehalten sind:
  - (i) Einrichtungen zur betrieblichen Altersversorgung oder vergleichbare Anlagevehikel, die auf Initiative eines oder mehrerer Arbeitgeber zugunsten ihrer Mitarbeiter eingerichtet wurden, und
  - (ii) Unternehmen mit einem oder mehreren Arbeitgebern, die Mittel investieren, um ihren Mitarbeitern Pensionsanwartschaften zu bieten;
- d) Teilfonds, deren vorrangiges Ziel die Anlage in Mikrofinanzinstitute ist;
- e) Teilfonds, Kategorien und/oder Klassen:
  - (i) deren Wertpapiere an mindestens einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, der anerkannt ist, ordnungsgemäß betrieben wird und für das Publikum offen ist, und
  - (ii) deren ausschließlicher Zweck die Nachbildung der Performance eines Index oder mehrerer Indizes ist.Existieren mehrere Anteilskategorien innerhalb des Teilfonds, gilt die Befreiung nur für die Anteilskategorien, welche die Bedingung von Unterpunkt (i) erfüllen.

Wenn sie geschuldet wird, ist die *Taxe d'Abonnement* vierteljährlich auf der Grundlage des entsprechenden Nettovermögens zahlbar und wird zum Ende des Quartals berechnet, auf das sie sich bezieht.

Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

**BESTEuerung DER ANLAGEN DER GESELLSCHAFT**

Ein Teil der Portfolioerträge der Gesellschaft, insbesondere Dividenden- und Zinserträge sowie bestimmte Kapitalerträge, können verschiedenen Steuersätzen und verschiedenen Steuerarten in den Ländern unterliegen, in denen sie erwirtschaftet werden. Grundsätzlich können diese Einkommen und Kapitalerträge auch ausländischer Quellensteuer unterliegen. In dieser Hinsicht hat das Großherzogtum Luxemburg jedoch Doppelbesteuerungsabkommen geschlossen, um dieses Steuerisiko zu begrenzen.

**BESTEuerung DER ANTEILINHABER**

Anteilinhaber unterliegen derzeit keiner luxemburger Kapitalertrags-, Einkommen-, Quellen-, Schenkungs-, Nachlass-, Erbschafts- oder sonstigen Steuer im Hinblick auf Anteile in ihrem Besitz (gegebenenfalls mit Ausnahme von Anteilinhabern, die in Luxemburg ansässig oder wohnhaft sind oder waren oder dort eine ständige Niederlassung haben).

Anlageinteressenten sollten sich über die Steuern informieren, die laut den Gesetzen ihres Herkunfts-, Wohnsitz- oder Aufenthaltslandes für den Erwerb, den Besitz und die Veräußerung von Anteilen der Gesellschaft und die Verteilung in dieser Hinsicht gelten.

**a) FATCA-Bestimmungen**

Laut den FATCA-Bestimmungen, die im luxemburger FATCA-Gesetz umgesetzt wurden, ist im Allgemeinen eine jährliche Berichterstattung an die luxemburger Steuerbehörden über den direkten und indirekten Besitz von nicht-US-Konten und nicht-US-Einrichtungen seitens US-Personen vorgesehen. Die luxemburger Steuerbehörden tauschen diese Informationen automatisch mit der Bundessteuerbehörde der USA aus. Das Versäumnis, die erforderlichen Informationen bereitzustellen, führt neben Strafen in Luxemburg zu einer 30 %-igen Quellensteuer auf bestimmte in den USA erzielte Einkommen (einschließlich Dividenden und Zinsen) und Bruttoerlöse aus dem Verkauf oder einer anderweitigen Veräußerung von Eigentum, die in den USA erwirtschaftete Zinsen oder Dividenden verursachen kann.

Die vorstehenden Bestimmungen basieren auf dem luxemburger FATCA-Gesetz sowie aktuell gültiger Praxis und unterliegen Änderungen. Anlageinteressenten wird empfohlen, sich über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen. Die Anleger werden außerdem auf bestimmte Steuerbestimmungen hingewiesen, die für spezifische Länder gelten, in denen die Gesellschaft ihre Anteile öffentlich vertreibt.

**b) Common Reporting Standard (CRS)**

Die OECD wurde von den G8/G20-Ländern beauftragt, einen globalen Berichtsstandard zu entwickeln, um zukünftig einen umfassenden und multilateralen automatischen Informationsaustausch (Automatic Exchange of Information, AEOI) auf globaler Basis zu erzielen. Der CRS verpflichtet luxemburger Finanzinstitute dazu, ihre Kontoinhaber zu identifizieren (auch im Falle von Anteilseignern und Gläubigern von Anlagegesellschaften) und zu bestimmen, ob sie ihren Steuersitz in Ländern haben, die dem multilateralen CRS-Abkommen angeschlossen sind. Die luxemburger Finanzinstitute melden dann die Finanzkontoinformationen der Kontoinhaber an die luxemburger Steuerbehörden, die diese Informationen einmal im Jahr automatisch an die zuständigen ausländischen Steuerbehörden übermitteln.

Der CRS wurde in die Richtlinie über die Zusammenarbeit der Verwaltungsbehörden (Directive on Administrative Cooperation, DAC 2) aufgenommen, die am 9. Dezember 2014 verabschiedet wurde und die die EU-Mitgliedstaaten bis zum 31. Dezember 2015 in ihr nationales Recht umsetzen müssen. Diesbezüglich wurde das luxemburger CRS-Gesetz vom 18. Dezember 2015 (das „**AEOI-Gesetz**“) am 24. Dezember 2015 im Mémorial A – N° 244 veröffentlicht.



Die Steuerbehörden der EU-Mitgliedstaaten müssen erstmals bis spätestens Ende September 2017 im Hinblick auf Informationen zum Steuerjahr 2016 gemäß der DAC 2 untereinander (sowie an die Steuerbehörden anderer „Earlier Adopter“-OECD-Länder) berichten. In anderen Rechtsordnungen wird der AEOI unter dem CRS nicht vor 2017 angewendet und wird von dem jeweiligen Land abhängig sein.

#### c) Datenschutz

Gemäß AEOI-Gesetz und Luxemburger Datenschutzregelungen muss jede betroffene Person über die Verarbeitung ihrer personenbezogenen Daten informiert werden, bevor das berichtende Luxemburger Finanzinstitut die Daten verarbeitet. Wenn die Person im vorgenannten Kontext als berichtspflichtige Person gilt, informiert die Gesellschaft die Person gemäß dem Luxemburger Datenschutzgesetz.

- In dieser Hinsicht ist die Gesellschaft als berichtendes Luxemburger Finanzinstitut für die Verarbeitung der personenbezogenen Daten verantwortlich und handelt im Sinne des AEOI-Gesetzes als Datenverantwortlicher.
- Die personenbezogenen Daten sollen im Sinne des AEOI-Gesetzes und des CRS bzw. der DAC 2 verarbeitet werden.
- Die Daten können an die Luxemburger Steuerbehörden (*Administration des contributions directes*) gemeldet werden, die diese Daten wiederum an die zuständigen Behörden einer oder mehrerer berichtspflichtiger Rechtsordnungen übermitteln können.
- Bei jeder Informationsanforderung im Sinne des AEOI-Gesetzes, die an die betroffene Person gesendet wird, ist diese Person zur Antwort verpflichtet. Wird eine Antwort innerhalb der vorgeschriebenen Frist versäumt, kann das Konto (fälschlicherweise oder doppelt) den Luxemburger Steuerbehörden gemeldet werden.
- Jede betroffene Person hat das Recht, auf Daten, die den Luxemburger Steuerbehörden im Sinne des AEOI-Gesetzes berichtet wurden, zuzugreifen und sie im Falle eines Fehlers berichtigen zu lassen.

Alle personenbezogenen Daten von Anteilhabern, die in den von diesen Anteilhabern bereitgestellten Dokumenten enthalten sind, und alle weiteren personenbezogenen Daten, die im Verlauf der Geschäftsbeziehung mit der Gesellschaft erhoben werden, können von der Gesellschaft oder der Verwaltungsgesellschaft erfasst, gespeichert, angepasst, weitergegeben oder anderweitig verarbeitet und verwendet (nachstehend „verarbeitet“) werden. Die Verarbeitung der Daten erfolgt zu Zwecken der Kontoverwaltung, Identifizierung von Geldwäsche und Entwicklung der Geschäftsbeziehung. Die Daten dürfen zu diesem Zweck an Unternehmen weitergegeben werden, die von der Gesellschaft oder der Verwaltungsgesellschaft zur Unterstützung der Tätigkeit der Gesellschaft bestellt wurden.

Jeder Anteilhaber erklärt sich mit der Unterzeichnung der Zeichnungsvereinbarung damit einverstanden, dass seine personenbezogenen Daten gemäß den geltenden gesetzlichen Bestimmungen zum Schutz natürlicher Personen bei der Verarbeitung personenbezogener Daten verarbeitet werden.

Weitere Einzelheiten zu den Bedingungen für die Datenverarbeitung sind auf Anfrage kostenlos am eingetragenen Sitz der Gesellschaft erhältlich.

Die Gesellschaft als Verantwortliche erhebt, speichert und verarbeitet die von den Anteilhabern zum Zeitpunkt ihrer Zeichnung angegebenen Daten elektronisch oder auf andere Weise zum Zweck der Erbringung der von den Anteilhabern verlangten Dienstleistungen und der Einhaltung ihrer gesetzlichen Verpflichtungen.

Alle von der Gesellschaft erhobenen Daten sind in Übereinstimmung mit den für das Großherzogtum Luxemburg geltenden Datenschutzbestimmungen und dem Datenschutzgesetz zu verarbeiten.

Zu den verarbeiteten Daten zählen der Name, die Anschrift und der Anlagebetrag jedes Anteilhabers sowie alle Daten (die „personenbezogenen Daten“), die von der Gesellschaft angefordert werden, um die Einhaltung der geltenden Vorschriften zur Bekämpfung der Geldwäsche/Know-Your-Customer und Verhinderung der Terrorismusfinanzierung sowie der FATCA- und CRS-Regeln zu gewährleisten.

Der Anleger kann in seinem Ermessen die Übermittlung seiner personenbezogenen Daten an die Gesellschaft verweigern. In einem solchen Falle kann die Gesellschaft jedoch den Antrag auf Zeichnung von Anteilen an der Gesellschaft ablehnen.

Die Verarbeitung der von den Anteilhabern angegebenen Daten erfolgt insbesondere zum Zweck (i) der Führung des Anteilhaberregisters, (ii) der Bearbeitung von Zeichnungen, Rücknahmen und Umtauschvorgängen von Anteilen und von Dividendenausschüttungen an die Anteilhaber, (iii) der Durchführung von Kontrollen bezüglich Late-Trading- und Market-Timing-Praktiken, (iv) der Einhaltung der geltenden Vorschriften zur Bekämpfung der Geldwäsche/Know-Your-Customer und Verhinderung der Terrorismusfinanzierung sowie der FATCA- und CRS-Regeln.

Die Gesellschaft kann die Verarbeitung der personenbezogenen Daten an ein anderes, in der Europäischen Union ansässiges Unternehmen (die Verwaltungsgesellschaft, die Vertriebsstelle, die Verwaltungsstelle, ggf. den Anlageverwalter oder die Registerstelle) delegieren. Die Gesellschaft kann personenbezogene Daten auch gemäß den geltenden Gesetzen und Vorschriften an Dritte, wie z. B. Regierungs- oder Regulierungsbehörden, einschließlich Steuerbehörden, innerhalb oder außerhalb der Europäischen Union übertragen

Der Anteilhaber hat das Recht:

- Auskunft über seine personenbezogenen Daten zu erhalten;
- seine personenbezogenen Daten zu korrigieren, wenn diese falsch oder unvollständig sind;
- der Verarbeitung seiner personenbezogenen Daten zu widersprechen;
- die Löschung seiner personenbezogenen Daten zu beantragen;
- unter bestimmten Bedingungen die Übertragbarkeit personenbezogener Daten zu beantragen.

Des Weiteren hat der Anteilhaber das Recht, der Verwendung seiner personenbezogenen Daten für Marketingzwecke zu widersprechen.

Der Anteilhaber kann seine vorstehenden Rechte durch schriftliche Mitteilung an die Gesellschaft an deren eingetragenen Sitz ausüben.

Der Anteilhaber erkennt außerdem an, dass er das Recht hat, eine Beschwerde bei der Nationalen Datenschutzkommission einzureichen.

Personenbezogene Daten dürfen vorbehaltlich der gesetzlich vorgeschriebenen Verjährungsfristen nicht länger als für den Zweck ihrer Verarbeitung nötig aufbewahrt werden.

### HAUPTVERSAMMLUNGEN DER ANTEILINHABER

Die Jahreshauptversammlung der Gesellschaft wird innerhalb von sechs Monaten nach Vorjahresende am Sitz der Gesellschaft oder an einem anderen Ort im Großherzogtum Luxemburg abgehalten, der in der Einberufung angegeben wird. Wenn es sich bei diesem Tag nicht um einen Bankgeschäftstag in Luxemburg handelt, findet die Jahreshauptversammlung am darauf folgenden Bankgeschäftstag statt. Gemäß den Bestimmungen der Luxemburger Gesetze und der Satzung können weitere Hauptversammlungen einberufen werden.

Einladungen an Anteilinhaber zur Teilnahme an Hauptversammlungen werden der in Luxemburger Gesetzen und der Satzung vorgeschriebenen Art und Weise und Frist entsprechend veröffentlicht, jedoch mindestens 14 Tage im Voraus. Einladungen an Anteilinhaber zur Teilnahme an Hauptversammlungen können den Anteilhabern neben den standardmäßigen Vereinbarungen zur Bekanntmachung auch per Post zugesendet werden.

Gleichermaßen werden Hauptversammlungen gemäß den Bestimmungen der Luxemburger Gesetze und der Satzung durchgeführt.

Jeder Anteil verleiht, unabhängig von seinem Wert, seinem Inhaber eine Stimme. Alle Anteile werden in Beschlüssen der Hauptversammlung gleich gewertet, wenn Beschlüsse die Gesellschaft insgesamt betreffen. Wenn die Beschlüsse die spezifischen Rechte der Anteilinhaber eines Teilfonds, einer Kategorie oder einer Klasse betreffen, dürfen nur die Inhaber von Anteilen dieses Teilfonds, dieser Kategorie oder dieser Klasse an der Abstimmung teilnehmen.

### INFORMATIONEN FÜR ANTEILINHABER

#### Nettoinventarwerte und Dividenden

Die Gesellschaft veröffentlicht die gesetzlich erforderlichen Informationen im Großherzogtum Luxemburg und in allen anderen Ländern, in denen die Anteile öffentlich angeboten werden.

Diese Informationen sind auch unter [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

#### Geschäftsjahr

Das Geschäftsjahr der Gesellschaft beginnt am 1. Januar und endet am 31. Dezember jedes Jahres.

#### Finanzberichte

Die Gesellschaft veröffentlicht einen von den Abschlussprüfern testierten Jahresbericht zum letzten Tag des Geschäftsjahres sowie einen nicht testierten halbjährlichen Zwischenbericht zum letzten Tag des sechsten Monats des Geschäftsjahres. Die Gesellschaft ist befugt, bei Bedarf eine vereinfachte Version des Finanzberichts zu veröffentlichen.

Die Finanzberichte der einzelnen Teilfonds werden in der Rechnungswährung des jeweiligen Teilfonds aufgestellt, die Erstellung der konsolidierten Abschlüsse erfolgt hingegen in Euro.

Der Jahresbericht wird innerhalb von vier Monaten nach Ende des Geschäftsjahres und der Zwischenbericht innerhalb von zwei Monaten nach dem Ende des Halbjahres veröffentlicht.

#### Dokumente zur Einsichtnahme

Die Satzung, der Prospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) und die periodischen Berichte liegen am Sitz der Gesellschaft und bei den für die Finanzdienstleistungen der Gesellschaft verantwortlichen Einrichtungen zur Einsicht aus. Exemplare der Satzung und der Jahres- und Zwischenberichte sind auf Anfrage erhältlich.

Informationen über Änderungen der Gesellschaft werden auf der Website der Verwaltungsgesellschaft oder in jeder Zeitung (im Online- oder Papierformat), die der Verwaltungsrat für zweckmäßig hält, in den Ländern veröffentlicht, in denen die Gesellschaft ihre Anteile öffentlich vertreibt.

Dokumente und Informationen werden auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar sein.

#### Anfragen und Beschwerden von Anlegern

Anteilinhaber können Anfragen oder Beschwerden hinsichtlich der Gesellschaft schriftlich an den eingetragenen Sitz der Gesellschaft richten:

49, avenue J.F. Kennedy  
L-1855 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

---

## ANHANG 1 – ANLAGEBESCHRÄNKUNGEN

---

1. Die Anlagen jedes Teilfonds bestehen ausschließlich aus einem oder mehreren der folgenden Elemente:
  - a) Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden, gemäß Definition in Richtlinie 2004/39;
  - b) Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten, regelmäßig betriebenen, anerkannten und öffentlich zugänglichen Markt eines EU-Mitgliedstaates gehandelt werden;
  - c) Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer Börse eines Nicht-EU-Mitgliedstaates offiziell notiert sind oder an einem anderen geregelten, regelmäßig betriebenen, anerkannten und öffentlich zugänglichen Markt in einem dieser Staaten gehandelt werden;
  - d) Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente aus Neuemissionen, sofern:
    - die Bedingungen der Emission eine Verpflichtung enthalten, nach der ein Antrag auf Zulassung zum offiziellen Handel an einer Börse oder einem anderen geregelten, regelmäßig betriebenen, anerkannten und öffentlich zugänglichen Markt zu stellen ist;
    - die Zulassung zur Notierung innerhalb eines Jahres nach der Emission erreicht wird;
  - e) Aktien oder Anteile von OGAW, die im Rahmen der Richtlinie 2009/65 zugelassen sind, und/oder andere OGA, unabhängig von ihrem Sitz in einem EU-Mitgliedstaat, sofern:
    - diese anderen Organismen für gemeinsame Anlagen gemäß Rechtsvorschriften zugelassen sind, die fordern, dass die Organisationen einer Überwachung unterliegen, die von der CSSF als der nach EU-Recht vorgesehenen Überwachung gleichwertig angesehen wird, und eine ausreichende Gewähr für eine Zusammenarbeit zwischen den Aufsichtsbehörden besteht;
    - das Aktionären oder Anteilhabern dieser anderen OGA garantierte Schutzniveau dem Schutzniveau für Aktionäre oder Anteilhaber eines OGAW vergleichbar ist und insbesondere die Vorschriften für die getrennte Verwahrung des Vermögens, die Kreditaufnahme, die Kreditgewährung sowie Leerverkäufe von übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten den Anforderungen der Richtlinie 2009/65 entsprechen;
    - die Geschäftstätigkeit dieser anderen OGA in Zwischen- und Jahresberichten beschrieben wird, sodass eine Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, Erträge und Transaktionen im betrachteten Zeitraum möglich ist;
    - der Anteil der Vermögenswerte von OGAW oder anderen OGA, die erworben werden sollen, der gemäß ihrem Verwaltungsreglement oder ihrer Satzung vollständig in die Anteile oder Aktien anderer OGAW oder anderer OGA investiert werden darf, maximal 10 % beträgt;
  - f) Einlagen bei Kreditinstituten, die auf Antrag rückzahlbar sind oder zurückgezogen werden können und eine Laufzeit von höchstens zwölf Monaten haben, vorausgesetzt, dass das Kreditinstitut seinen eingetragenen Sitz in einem EU-Mitgliedstaat hat oder, wenn sich der eingetragene Sitz des Kreditinstituts in einem Drittstaat befindet, aufsichtsrechtlichen Regelungen unterworfen ist, die die CSSF als denen nach EU-Recht gleichwertig erachtet;
  - g) Finanzderivate, einschließlich gleichwertiger Instrumente mit Barausgleich, die auf einem wie unter vorstehenden Buchstaben a), b) und c) beschriebenen geregelten Markt gehandelt werden, und/oder außerbörslich (over-the-counter) gehandelte Finanzderivate („**OTC-Derivate**“), sofern:
    - es sich bei den Basiswerten um Instrumente im Sinne dieses Punktes 1., um Finanzindizes, Zinssätze, Wechselkurse und Währungen handelt, in die der betreffende Teilfonds gemäß den in der Satzung genannten Anlagezielen investieren darf;
    - es sich bei den Gegenparteien der Transaktionen mit OTC-Derivaten um Einrichtungen handelt, die einer ordnungsgemäßen Aufsicht unterliegen und den von der Luxemburger Aufsichtsbehörde zugelassenen Kategorien angehören, und
    - die OTC-Derivate täglich zuverlässig und überprüfbar bewertet werden und jederzeit auf Initiative der Gesellschaft zum beizulegenden Zeitwert veräußert, liquidiert oder durch ein Gegengeschäft glattgestellt werden können;
  - h) Geldmarktinstrumente, die nicht an einem geregelten Markt gehandelt werden und in Artikel 1 des Gesetzes nicht aufgeführt sind, sofern die Emission oder der Emittent dieser Instrumente selbst zum Schutze der Anleger und Erträge reglementiert wird, und sofern diese Instrumente:
    - von einer zentralen, regionalen oder lokalen Behörde oder einer Zentralbank eines EU-Mitgliedstaats, der Europäischen Zentralbank, der Europäischen Union oder der Europäischen Investitionsbank, einem Drittstaat oder, sofern es Bundesländer gibt, von einem der Mitglieder, die die Föderation bilden, oder einer internationalen öffentlich-rechtlichen Körperschaft, der einer oder mehrere EU-Mitgliedstaaten angehören, ausgegeben oder garantiert werden, oder
    - von einer Gesellschaft ausgegeben werden, deren Wertpapiere an den unter Buchstabe a), b) oder c) oben genannten geregelten Märkten gehandelt werden, oder
    - durch eine Einrichtung ausgegeben oder garantiert werden, die aufsichtsrechtlichen Regelungen unterliegt, die mit den durch EU-Recht vorgegebenen Kriterien übereinstimmen, oder durch eine Einrichtung, die aufsichtsrechtlichen Regelungen unterliegt und mit diesen konform geht, die die CSSF als mindestens so strikt wie die durch das EU-Recht festgesetzten Regeln erachtet; oder
    - von sonstigen Emittenten ausgegeben werden, die einer von der CSSF zugelassenen Kategorie angehören, sofern für Anlagen in diesen Instrumenten Regeln für den Anlegerschutz gelten, die den in den unmittelbar vorstehenden ersten, zweiten oder dritten Unterbuchstaben beschriebenen Regeln gleichwertig sind, und sofern es sich bei dem Emittenten um eine Gesellschaft handelt, deren Eigenkapital mindestens zehn Millionen Euro (EUR 10.000.000) beträgt und deren Jahresabschluss gemäß der Vierten Richtlinie 78/660/EWG erstellt und veröffentlicht wird, oder es sich um einen Rechtsträger handelt, der innerhalb einer Unternehmensgruppe, die eine oder mehrere börsennotierte Gesellschaften umfasst, für die Finanzierung dieser Gruppe zuständig ist, oder es sich um einen Rechtsträger handelt, der die wertpapiermäßige Unterlegung von Verbindlichkeiten durch Nutzung einer von einer Bank eingeräumten Kreditlinie finanzieren soll.
2. Ein Teilfonds darf jedoch nicht:
  - a) mehr als 10 % seiner Vermögenswerte in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten anlegen, die nicht unter Punkt 1 aufgeführt sind;
  - b) Edelmetalle oder Edelmetall-Zertifikate erwerben;Ein Teilfonds kann als Beimischung flüssige Mittel halten.
3. Die Gesellschaft kann bewegliches und unbewegliches Vermögen erwerben, das für die unmittelbare Ausübung ihrer Geschäftstätigkeit wesentlich ist.

4.

- a) Ein Teilfonds darf höchstens 10 % seiner Vermögenswerte in übertragbaren Wertpapieren oder Geldmarktinstrumenten ein und desselben Emittenten anlegen.

Ein Teilfonds darf höchstens 20 % seiner Vermögenswerte in Einlagen bei ein und derselben Einrichtung anlegen.

Das Gegenparteirisiko eines Teilfonds bei Transaktionen mit OTC-Derivaten darf 10 % seine Vermögenswerte nicht überschreiten, wenn die Gegenpartei ein Kreditinstitut im Sinne von Punkt 1.f) ist. Für andere Fälle beträgt die Grenze maximal 5 % der Vermögenswerte.

- b) Der Gesamtwert der von einem Teilfonds gehaltenen übertragbaren Wertpapiere und Geldmarktinstrumente von Emittenten, bei denen er jeweils mehr als 5 % seiner Vermögenswerte anlegt, darf 40 % des Wertes seines Vermögens nicht überschreiten. Diese Grenze gilt nicht für Einlagen bei Finanzinstituten, die aufsichtsrechtlichen Regelungen unterliegen, sowie für OTC-Derivatvtransaktionen mit diesen Instituten.

Ungeachtet der einzelnen unter Buchstabe a) definierten Obergrenzen darf ein Teilfonds nicht mehrere der folgenden Anlageformen kombinieren, wenn dadurch im Ergebnis mehr als 20 % seiner Vermögenswerte bei ein und derselben Einrichtung angelegt wären:

- Anlagen in übertragbaren Wertpapieren oder Geldmarktinstrumenten, die von dieser Einrichtung ausgegeben werden,
- Einlagen bei dieser Einrichtung, oder
- Risiken aus OTC-Derivatetransaktionen mit dieser Einrichtung.

- c) Die im ersten Absatz von Buchstabe a) beschriebene Beschränkung kann auf maximal 35 % angehoben werden, wenn die übertragbaren Wertpapiere oder Geldmarktinstrumente von einem Mitgliedstaat der Europäischen Union, von seinen regionalen öffentlichen Behörden, von einem Drittstaat oder von internationalen öffentlich-rechtlichen Körperschaften, denen ein oder mehrere EU-Mitgliedstaaten angehören, ausgegeben oder garantiert werden.

- d) Die im ersten Absatz von Abschnitt a) festgeschriebene Grenze kann auf maximal 25 % für gedeckte Anleihen gemäß Definition in Artikel 3(1) der Richtlinie (EU) 2019/2162 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über die Emission gedeckter Schuldverschreibungen und die öffentliche Aufsicht über gedeckte Schuldverschreibungen und zur Änderung der Richtlinien 2009/65/EG und 2014/59/EU (die „Richtlinie (EU) 2019/2162“) sowie für bestimmte Anleihen angehoben werden, die vor dem 08. Juli 2022 durch ein Kreditinstitut begeben werden, das seinen eingetragenen Sitz in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union hat und das rechtlich der besonderen Aufsicht durch die Behörden zum Schutz von Anleihehabern unterliegt. Insbesondere sind Mittel, die aus der Emission dieser Anleihen vor dem 8. Juli 2022 entstehen, gemäß der Rechtsprechung in Vermögenswerten anzulegen, die während der Lebensdauer der Anleihen die sich aus den Anleihen ergebenden Schulden decken können und im Falle eines Bankrotts des Emittenten vorrangig für die Rücknahme des Kapitals und die Zahlung der aufgelaufenen Zinsen verwendet werden.

Legt ein Teilfonds mehr als 5 % seiner Vermögenswerte in Schuldverschreibungen im Sinne des ersten Absatzes an, die von ein und demselben Emittenten begeben werden, so darf der Gesamtwert dieser Anlagen 80 % des Wertes der Vermögenswerte des Teilfonds nicht überschreiten.

- e) Die unter den Buchstaben c) und d) genannten übertragbaren Wertpapiere und Geldmarktinstrumente werden bei der Anwendung der unter Buchstabe b) vorgesehenen Anlagegrenze von 40 % nicht berücksichtigt.

Die unter Buchstaben a), b), c) und d) genannten Grenzen dürfen nicht kumuliert werden; daher dürfen gemäß den Buchstaben a), b), c) und d) getätigte Anlagen in übertragbaren Wertpapieren oder Geldmarktinstrumenten ein und desselben Emittenten oder in Einlagen bei diesem Emittenten oder in Derivaten desselben 35 % der Vermögenswerte des Teilfonds nicht übersteigen.

Gesellschaften, die in eine konsolidierte Wirtschaftseinheit gemäß Definition in der Richtlinie 83/349 oder gemäß anerkannten internationalen Rechnungslegungsstandards zusammengefasst sind, werden für die Berechnung der in diesem Punkt 4 genannten Grenzen als ein einziges Unternehmen betrachtet.

Ein Teilfonds darf kumulativ insgesamt bis zu 20 % seiner Vermögenswerte in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten ein und derselben Unternehmensgruppe anlegen.

5. Unbeschadet der unter Punkt 8. festgelegten Anlagegrenzen werden die unter Punkt 4. genannten Obergrenzen für Anlagen in Aktien und/oder Schuldtiteln ein und desselben Emittenten auf maximal 20 % erhöht, wenn das Ziel der Anlagepolitik des Teilfonds darin besteht, einen bestimmten, von der CSSF anerkannten Aktien- oder Schuldtitelindex nachzubilden. Voraussetzung hierfür ist, dass:

- die Zusammensetzung des Index ausreichend gestreut ist;
- der Index eine repräsentative Benchmark für den Markt darstellt, auf den er sich bezieht;
- eine entsprechende Veröffentlichung erfolgt ist.

Die im vorstehenden Satz festgelegte Grenze wird auf 35 % angehoben, sofern dies aufgrund außergewöhnlicher Marktbedingungen gerechtfertigt ist, insbesondere an geregelten Märkten, an denen bestimmte übertragbare Wertpapiere oder Geldmarktinstrumente stark dominieren. Die Anlage bis zu diesem Grenzwert ist nur für einen einzigen Emittenten gestattet.

6. Abweichend von Punkt 4. kann ein Teilfonds nach dem Grundsatz der Risikostreuung bis zu 100 % seiner Vermögenswerte in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten verschiedener Emissionen anlegen, die von einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder seinen Gebietskörperschaften oder von einem Mitgliedstaat der OECD, von Brasilien, Indonesien, Russland, Singapur und Südafrika, oder von internationalen Organisationen öffentlich-rechtlichen Charakters, denen ein oder mehrere Mitgliedstaaten der Europäischen Union angehören, ausgegeben oder garantiert werden.

Diese Wertpapiere müssen aus mindestens sechs verschiedenen Emissionen stammen, wobei die Wertpapiere jeder einzelnen Emission nicht mehr als 30 % des Gesamtbetrags darstellen dürfen.

7.

- a) Ein Teilfonds darf Aktien oder Anteile an OGAW und/oder anderen OGA im Sinne von Punkt 1.e) erwerben, wenn er nicht mehr als 20 % seiner Vermögenswerte in ein und demselben OGAW oder einem anderen OGA anlegt. Bei der Anwendung dieser Anlagegrenze ist jeder Teilfonds eines Umbrellafonds im Sinne von Artikel 181 des Gesetzes wie ein eigenständiger Emittent zu betrachten, vorausgesetzt, das Prinzip der Einzelhaftung jedes Teilfonds im Hinblick auf Dritte findet Anwendung.

- b) Anlagen in Anteilen von anderen OGA als OGAW dürfen insgesamt 30 % der Vermögenswerte des Teilfonds nicht übersteigen. Wenn ein Teilfonds Aktien oder Anteile eines OGAW und/oder anderer OGA erworben hat, werden die Anlagewerte des betreffenden OGAW oder anderen OGA in Bezug auf die unter Punkt 4. genannten Obergrenzen nicht berücksichtigt.

- c) Aufgrund der Tatsache, dass die Gesellschaft in Anteile oder Aktien von OGA investieren kann, ist der Anleger einem Risiko doppelter Gebühren ausgesetzt (beispielsweise die Verwaltungsgebühren des OGA, in den die Gesellschaft investiert ist).

Ein Teilfonds darf nicht in einen (zugrunde liegenden) OGAW oder einen anderen (zugrunde liegenden) OGA investieren, der eine jährliche Verwaltungsgebühr von über 3 % erhebt.

Wenn ein Teilfonds jedoch Anlagen in Anteilen anderer OGAW und/oder OGA tätigt, die direkt oder im Auftrag von derselben Verwaltungsgesellschaft oder einer anderen Gesellschaft verwaltet werden, mit der die Verwaltungsgesellschaft durch eine gemeinsame Verwaltung oder Kontrolle oder durch eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung verbunden ist, trägt der Teilfonds keine Zeichnungs- oder Rücknahmegebühren der Anteile dieser zugrunde liegenden Werte.

Die maximale jährliche Verwaltungsgebühr, die direkt vom Teilfonds getragen wird, ist in Teil II aufgeführt.

8.

- a) Die Gesellschaft darf keine Anteile erwerben, die mit Stimmrechten behaftet sind, wenn diese sie zu einer erheblichen Einflussnahme auf die Verwaltung eines Emittenten berechtigen würden.
- b) Außerdem darf die Gesellschaft nicht mehr erwerben als:
  - 10 % der stimmrechtslosen Aktien eines einzelnen Emittenten;
  - 10 % der Schuldtitel eines einzelnen Emittenten;
  - 25 % der Anteile oder Aktien eines einzelnen OGAW oder anderen OGA gemäß Definition in Artikel 2, Absatz 2 des Gesetzes;
  - 10 % der von einem einzelnen Emittenten ausgegebenen Geldmarktinstrumente.

Die unter dem zweiten, dritten und vierten Spiegelstrich oben angegebenen Anlagegrenzen können zum Zeitpunkt des Erwerbs außer Acht gelassen werden, wenn zu dieser Zeit der Bruttobetrag der Anleihen oder Geldmarktinstrumente bzw. der Nettobetrag der ausgegebenen Wertpapiere nicht berechnet werden kann.

- c) Buchstaben a) und b) gelten nicht für:
  - von einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder dessen regionalen Behörden ausgegebene oder garantierte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente;
  - übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die durch einen Nicht-EU-Mitgliedstaat ausgegeben oder garantiert werden;
  - übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die von internationalen Organisationen mit einem öffentlichen Auftrag, bei denen ein oder mehrere Mitgliedstaaten der Europäischen Union Mitglied sind, ausgegeben werden;
  - Anteile, die von der Gesellschaft am Kapital einer Gesellschaft eines Staates außerhalb der Europäischen Union gehalten werden, die ihre Vermögenswerte hauptsächlich in Wertpapiere von Emittenten aus diesem Staat investiert, wenn aufgrund dessen Gesetzgebung ein solcher Besitz für die Gesellschaft die einzige Möglichkeit der Anlage in Wertpapieren der Emittenten dieses Staates darstellt. Diese Ausnahme findet jedoch nur Anwendung, wenn die Gesellschaft des Staates außerhalb der Europäischen Union in ihrer Anlagepolitik die in den Punkten 4., 7. und 8. a) und b) festgelegten Grenzen einhält. Bei Überschreitung der unter Punkt 4. und 7. vorgesehenen Grenzen findet Punkt 9. sinngemäß Anwendung;

9. Bei der Ausübung von Bezugsrechten, die an übertragbare Wertpapiere oder Geldmarktinstrumente geknüpft sind, die zu ihren Vermögenswerten zählen, brauchen die Teilfonds die in diesem Anhang vorgesehenen Anlagegrenzen nicht einzuhalten.

Unbeschadet ihrer Verpflichtung, auf die Einhaltung des Grundsatzes der Risikostreuung zu achten, können neu zugelassene Teilfonds während eines Zeitraums von sechs Monaten nach ihrer Zulassung von den unter den Punkten 4., 5., 6. und 7. festgelegten Bestimmungen abweichen.

Werden die in Absatz 1 genannten Grenzen von einem Teilfonds unbeabsichtigt oder infolge der Ausübung von Bezugsrechten überschritten, so muss der betreffende Teilfonds im Rahmen der von ihm getätigten Verkäufe von Vermögenswerten vorrangig die Abhilfe dieser Situation unter Berücksichtigung der Interessen der Anteilhaber anstreben.

10. Ein Teilfonds kann Fremdwährungen durch „Back-to-Back“-Darlehen (Parallelkredite) erwerben.

Ein Teilfonds darf folgende Kredite aufnehmen, sofern diese Kredite:

- a) vorübergehender Art sind und maximal 10 % seiner Vermögenswerte repräsentieren;
  - b) dem Erwerb von unbeweglichem Anlagevermögen dienen, das für die unmittelbare Ausübung seiner Geschäftstätigkeit wesentlich ist, und maximal 10 % seiner Vermögenswerte repräsentieren.
- Ist ein Teilfonds zur Darlehensaufnahme unter den Buchstaben a) und b) berechtigt, dürfen diese Darlehen 15 % seines Gesamtvermögens nicht übersteigen.

11. Unbeschadet der Bestimmungen unter Punkten 1, 2., 3. und in Anhang 2 darf ein Teilfonds keine Kredite gewähren oder für Dritte als Bürge eintreten.

Der vorangehende Absatz hindert einen Teilfonds nicht am Erwerb von übertragbaren Wertpapieren, Geldmarktinstrumenten oder sonstigen Finanzinstrumenten im Sinne der Punkte 1.e), g) und h), die nicht voll eingezahlt sind.

12. Ein Teilfonds darf keine Leerverkäufe von übertragbaren Wertpapieren, Geldmarktinstrumenten oder anderen Finanzinstrumenten im Sinne der Punkte 1. e), g) und h) tätigen.

13. Abweichend von den vorstehenden Beschränkungen darf ein als „Feeder“ bezeichneter Teilfonds anlegen:

- a) mindestens 85 % seiner Vermögenswerte in Aktien oder Anteilen eines anderen OGAW oder eines anderen Teilfonds eines OGAW (der „Master“);
- b) bis zu 15 % seiner Vermögenswerte in eine oder mehrere der folgenden Anlagen:
  - Barmittel, als Beimischung,
  - Finanzderivate, deren Einsatz gemäß Punkt 1.g) und Anhang 2 auf Absicherungszwecke beschränkt ist;
  - bewegliches und unbewegliches Anlagevermögen, das für die unmittelbare Ausübung seiner Geschäftstätigkeit wesentlich ist.

14. Ein Teilfonds kann Anteile eines oder mehrerer anderer Teilfonds der Gesellschaft (der „Ziel-Teilfonds“) erwerben, sofern:

- der Ziel-Teilfonds nicht seinerseits in dem Teilfonds anlegt;
- der Anteil der Vermögenswerte, die jeder Ziel-Teilfonds in anderen Ziel-Teilfonds der Gesellschaft anlegt, 10 % nicht überschreitet;
- die mit den Anteilen der Ziel-Teilfonds verbundenen Stimmrechte so lange ausgesetzt werden, wie sie im Besitz des Teilfonds sind, unbeschadet ihrer angemessenen Behandlung in den Finanzberichten und Jahres- und Halbjahresberichten;

- in allen Fällen, der Wert dieser Anteile, solange diese in Zielfonds von der Gesellschaft gehalten werden, nicht zur Berechnung des Nettovermögens der Gesellschaft zum Zweck der Überprüfung des gesetzlich vorgeschriebenen Untergrenze für das Nettovermögens herangezogen wird;
  - es auf der Ebene des Teilfonds, der in den Zielfonds investiert hat, und diesem Ziel-Teilfonds nicht zu einer Verdoppelung der Kosten für Verwaltungs-/Zeichnungs- oder Rücknahmegebühren kommt.
15. Ein Teilfonds der Gesellschaft darf nicht mehr als 20 % seines Nettovermögens in vermögensbesicherten Wertpapieren (Asset Backed Securities, ABS) bzw. hypothekarisch besicherten Wertpapieren (Mortgage Backed Securities, MBS) anlegen.
  16. Ein Teilfonds der Gesellschaft, dessen Zweck in der hauptsächlichen Anlage in Aktien besteht (mit Ausnahme der „Profile“-Teilfonds), geht kein Engagement in notleidenden Vermögenswerten ein.
  17. Die nicht unter 16. aufgeführten Teilfonds der Gesellschaft gehen kein aktives Engagement in notleidenden Vermögenswerten ein. Falls es zu einem Engagement in einem notleidenden Vermögenswert kommt, wird der Manager versuchen, die Position innerhalb eines angemessenen Zeitraums zu verkaufen, wobei er insbesondere die Marktbedingungen und die besten Interessen der Anteilhaber berücksichtigt.
  18. Die Teilfonds der Gesellschaft gehen kein aktives Engagement in CoCo-Bonds ein. Falls es zu einem Engagement in CoCo-Bonds kommt, beispielsweise aufgrund von Kapitalmaßnahmen, wird der Manager versuchen, die Position innerhalb eines angemessenen Zeitraums zu verkaufen, wobei er insbesondere die Marktbedingungen berücksichtigt.

Als allgemeine Regel behält sich der Verwaltungsrat das Recht vor, zu jeder Zeit weitere Anlagebeschränkungen einzuführen, wenn dies für die Einhaltung der in bestimmten Staaten, in denen Anteile der Gesellschaft angeboten und verkauft werden, geltenden Gesetze und Richtlinien notwendig ist. Andererseits behält sich der Verwaltungsrat das Recht vor, soweit gemäß den geltenden Gesetzen und Vorschriften zulässig, einen oder mehrere Teilfonds in Ausnahmefällen von den vorstehenden Anlagebeschränkungen zu befreien. Diese Ausnahmen werden für jeden der betroffenen Teilfonds in den Abschnitten über die Anlagepolitik in Teil II angegeben.

---

## ANHANG 2 – TECHNIKEN, FINANZINSTRUMENTE UND ANLAGEPOLITIKEN

---

Unbeschadet der für einen oder mehrere bestimmte Teilfonds geltenden spezifischen Bestimmungen ist es der Gesellschaft gestattet, für jeden Teilfonds gemäß den nachstehenden Modalitäten Finanzderivate im Sinne von Anhang 1, Punkt 1.g) des Prospekts zu verwenden.

Jeder Teilfonds darf als Teil seiner Anlagepolitik innerhalb der in Anhang 1 des Prospekts unter Punkt 1. festgelegten Grenzen Anlagen in Finanzderivaten tätigen, sofern das Gesamtrisiko der Basiswerte die Anlagegrenzen gemäß Punkt 4. in Anhang 1 des Prospekts nicht überschreitet. Wenn ein Teilfonds in Finanzderivaten anlegt, die auf einem **Index** basieren, müssen diese Anlagen nicht notwendigerweise bei den Anlagegrenzen von Anhang 1, Punkt 4. des Prospekts berücksichtigt werden.

Wenn ein übertragbares Wertpapier oder ein Geldmarktinstrument ein Derivat beinhaltet, muss dieses Derivat für Zwecke der Anwendung der vorliegenden Bestimmungen berücksichtigt werden.

### 1. Allgemeine Informationen

Die Gesellschaft darf Derivate, deren Basiswerte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sein können, sowohl zu Zwecken der Absicherung (Hedging) als auch zu Zwecken der Anlage (Investment) verwenden.

Wenn die genannten Geschäfte mit dem Einsatz von Derivaten verbunden sind, müssen diese Bedingungen und Obergrenzen den Bestimmungen von Anhang 1 des Prospekts entsprechen.

Wenn ein Teilfonds Derivate zu Anlagezwecken (Trading) einsetzt, darf er sie nur innerhalb der Beschränkungen seiner Anlagepolitik verwenden.

#### 1.1. Ermittlung des Gesamtrisikos

Gemäß dem Rundschreiben 11/512 muss die Verwaltungsgesellschaft das Gesamtrisiko des Teilfonds mindestens einmal täglich berechnen. Die Grenzen für das Gesamtrisiko müssen fortlaufend eingehalten werden.

Es liegt in der Verantwortung der Verwaltungsgesellschaft, eine angemessene Methodik zur Berechnung des Gesamtrisikos auszuwählen. Insbesondere sollte die Auswahl auf einer Selbsteinschätzung des Risikoprofils des Teilfonds durch die Verwaltungsgesellschaft beruhen, das sich aus seiner Anlagepolitik (einschließlich der Verwendung von Finanzderivaten) ergibt.

#### 1.2. Verfahren der Risikomessung gemäß dem Risikoprofil des Teilfonds

Die Teilfonds werden entsprechend der Selbsteinschätzung ihres sich aus ihrer Anlagepolitik ergebenden Risikoprofils unter Berücksichtigung ihrer jeweiligen Derivatestrategie eingestuft, die zwei Methoden zur Berechnung von Risiken bestimmt:

- Die erweiterte Methodik zur Risikomessung wie der VaR-Ansatz (Value-at-Risk) zur Berechnung des Gesamtrisikos, wenn:
  - (a) der Teilfonds komplexe Anlagestrategien einsetzt, die mehr als einen unerheblichen Teil der Anlagepolitik eines Teilfonds ausmachen;
  - (b) der Teilfonds mehr als eine unerhebliche Position in exotischen Derivaten hält; oder
  - (c) der Commitment-Ansatz das Marktrisiko des Portfolios nicht angemessen erfasst.

**Der/Die nach VaR beurteilte(n) Teilfonds ist/sind unter Punkt 1.5 aufgeführt.**

- Der Commitment-Ansatz zur Berechnung des Gesamtrisikoprofils sollte in allen sonstigen Fällen angewandt werden.

#### 1.3. Berechnung des Gesamtrisikos

##### 1.3.1. Für Teilfonds, die nach dem Commitment-Ansatz bewertet werden, gilt:

- Die Commitment-Conversion für **Standardderivate** ist immer der Marktwert der äquivalenten Position im Basiswert. Dies kann durch den Nennwert oder den Preis des Futures-Kontrakts ersetzt werden, wenn dies vorsichtiger ist.
- Für **Derivate, die als nicht standardmäßig eingestuft werden**, kann ein alternativer Ansatz angewandt werden, sofern der Gesamtbetrag dieser Derivate einen unerheblichen Anteil am Portfolio eines Teilfonds ausmacht.
- Die Berechnungsmethode für **strukturierte Teilfonds** wird in den Leitlinien 2012/197 der ESMA dargelegt

Ein Finanzderivat wird bei der Berechnung des Commitment nicht berücksichtigt, wenn es beide der folgenden Bedingungen erfüllt:

- (a) Die Derivateposition eines Teilfonds, die sich auf einen in risikofreien Anlagen investierten finanziellen Vermögens- und Kassawert bezieht, ist einer Kassaposition in einem bestimmten finanziellen Vermögenswert gleichwertig.
- (b) Es wird nicht davon ausgegangen, dass das Finanzderivat zusätzliches Risiko und Hebelung oder Marktrisiko erzeugt.

Das Gesamtrisiko des Teilfonds aus der Verwendung von derivativen Finanzinstrumenten, welches auf 100 % seines Nettovermögens begrenzt ist, entspricht allen einzelnen Verbindlichkeiten nach Aufrechnung eventueller Gegenforderungen und Deckungsposten.

##### 1.3.2. Bei Teilfonds, bei denen das „VaR“-Verfahren zur Anwendung kommt, wird das Gesamtrisiko einmal pro Tag ermittelt, indem der wahrscheinliche maximale Verlust unter regulären Marktbedingungen auf der Grundlage eines vorgegebenen Konfidenzintervalls innerhalb eines bestimmten Zeithorizonts ermittelt wird.

Je nach Risikoprofil und Anlagepolitik eines Teilfonds können der relative VaR-Ansatz oder der absolute VaR-Ansatz angewandt werden:

- Beim **relativen VaR-Ansatz** wird ein Portfolio ohne Hebelung definiert, das die Anlagepolitik widerspiegelt. Der VaR des Teilfonds darf den doppelten VaR dieses Referenzportfolios nicht überschreiten.
- Der **absolute VaR-Ansatz** ist für Teilfonds geeignet, die in mehrere Anlageklassen investieren und deren Anlageziel nicht an einer Benchmark sondern an einer absoluten Rendite gemessen wird; das Niveau des absoluten VaR beträgt maximal 20 %.

Die **VaR-Grenzen** sollten immer entsprechend dem definierten Risikoprofil festgelegt werden.

Zur Berechnung des VaR sind folgende Parameter zu verwenden: Ein Konfidenzniveau von 99 %, eine Haltedauer von einem Monat (20 Tage) und ein tatsächlicher (historischer) Beobachtungszeitraum für Risikofaktoren von mindestens 1 Jahr (250 Tage).

Die Verwaltungsgesellschaft führt ein monatliches **Backtesting**-Programm durch und berichtet der Geschäftsführung übermäßige Anzahlen an Ausreißern auf Quartalsbasis.

Die Verwaltungsgesellschaft führt monatlich **Stresstests** durch, um das Management der Risiken zu erleichtern, die mit möglichen anormalen Marktbewegungen zusammenhängen.

1.4. Aufstellung der Teilfonds, deren Gesamtengagement auf der Grundlage des Commitment-Ansatzes berechnet wird, und ihrer Referenzportfolios.

Durch Anwendung des Commitment-Ansatzes entsprechend der Beschreibung unter Punkt 1.3.1 oben überschreitet das Gesamtengagement eines jeden Teilfonds nicht den gesamten Nettoinventarwert des Portfolios dieses Teilfonds.

Ungeachtet der obigen Ausführungen gilt ergänzend, dass das Engagement berechnet wird auf der Basis (i) der Summe des absoluten Wertes der Nominalwerte der Derivate und der Anlagen in übertragbaren Wertpapieren (einschließlich der Barmittel, ohne Netting- und Absicherungsvereinbarungen), unter Annahme, dass die direkten und indirekten Engagements berücksichtigt werden, um das Gesamtengagement zu berechnen und (ii) geteilt wird durch den gesamten NIW des Teilfonds, wie in der nachfolgenden Tabelle dargelegt:

<b>Teilfonds</b>	<b>Referenzportfolio*</b>	<b>Erwartetes Engagement</b>	<b>Maximales Engagement</b>
Aegon Global Impact Equities	MSCI World TR Net	100 %	120 %
Amundi European ESG Equities	MSCI Europe TR Net	100 %	120 %
Aristotle US Equities	MSCI USA TR Net	100 %	120 %
Baring Emerging Markets ESG Bonds	50 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR + 50 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR	150 %	400 %
Blackrock Euro Government ESG Bonds	Bloomberg Euro Treasury 1-10 Year	125 %	200 %
Boston Common US Sustainable Equities	MSCI USA TR Net	100 %	120 %
Boston Common Emerging Markets ESG Equities	MSCI Emerging Markets TR Net	100 %	120 %
Boston Trust Walden US ESG Equities	MSCI USA Value TR Net	100 %	120 %
Candriam Emerging Markets ESG Bonds	50 % JP Morgan EMBI Global Diversified EUR + 50 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified EUR	150 %	400 %
Candriam Euro ESG Short Term Bonds	Euribor 3 Months	125 %	200 %
Candriam European ESG Convertibles	Thomson Reuters Europe Focus Hedged Convertible Bond (EUR)	125 %	200 %
Candriam European ESG Smaller Companies Equities	MSCI European Small Cap TR Net	100 %	120 %
Candriam European ESG Equities	MSCI Europe TR Net	100 %	120 %
Candriam French ESG Equities	MSCI France TR Net	100 %	120 %
Candriam Global ESG Convertibles	Thomson Reuters Global Focus Hedged Convertible Bond (EUR)	125 %	200 %
Candriam Global Dividend Equities	MSCI AC World TR Net	100 %	120 %
Candriam Global ESG High Yield Bonds	Bloomberg Global High Yield Corporate EUR hedged	150 %	400 %
Candriam Total Return Global Bonds	ICE BofAML Euro Corporate	150 %	200 %
Candriam Total Return Global Equities	50 % MSCI World TR Net + 25 % ICE BofAML 1–10 Year Euro Government + 25 % EUR thesaurierter STR	125 %	200 %
EdenTree European Sustainable Equities	MSCI Europe TR Net	100 %	120 %
Emerging Markets ESG Equities	MSCI Emerging Markets TR Net	100 %	120 %
Global ESG Equities	MSCI World TR Net	100 %	120 %
Impax US ESG Equities	MSCI USA TR Net	100 %	120 %
Insight Euro Aggregate Bonds	Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year	125 %	200 %



<b>Teilfonds</b>	<b>Referenzportfolio*</b>	<b>Erwartetes Engagement</b>	<b>Maximales Engagement</b>
Insight Euro ESG Corporate Bonds	Bloomberg Euro Aggregate Corporate	125 %	200 %
Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged	ICE BofAML Duration Hedged Euro Corporate	300 %	400 %
JPMorgan Asia Pacific ESG Equities	MSCI Pacific net Total Return USD	100 %	120 %
Kempen Euro Corporate Bonds	Bloomberg Euro Aggregate Corporate	125 %	200 %
Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged	ICE BofAML Duration Hedged Euro Corporate	300 %	400 %
Liontrust European Sustainable Equities	MSCI Europe TR Net	100 %	120 %
Liontrust Global Impact Equities	MSCI World TR Net	100 %	120 %
M&G Emerging Market Equities	MSCI Emerging Markets TR Net	100 %	120 %
Numeric Emerging Markets Equities	MSCI Emerging Markets TR Net	100 %	120 %
Parnassus US ESG Equities	MSCI USA TR Net	100 %	120 %
Portfolio High Quality Impact Bonds	Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year excluding Corporates and Securitized Index	125 %	200 %
Private Portfolio Bonds	Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year	120 %	150 %
Private Portfolio Equities	50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10 % MSCI EM TR Net	100 %	120 %
Putnam US ESG Equities	MSCI USA Growth TR Net	100 %	120 %
Pzena European Equities	MSCI Europe TR Net	100 %	120 %
Pzena US Equities	MSCI USA TR Net	100 %	120 %
Robeco Euro ESG Government-Related Bonds	Bloomberg Euro Government Related 1-10 Year	125 %	200 %
Sands Emerging Markets Equities	MSCI Emerging Markets TR Net	100 %	120 %
Schroder Euro Corporate ESG Bonds	Bloomberg Euro Aggregate Corporate	125 %	200 %
Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged	ICE BofAML Duration Hedged Euro Corporate	300 %	400 %
Walter Scott European ESG Equities	MSCI Europe TR Net	100 %	120 %
FoM Pacific Equities	MSCI Pacific TR Net	105 %	120 %
FoM Emerging Market Equities	MSCI Emerging Markets TR Net	105 %	120 %
FoM Euro Corporate Bonds	Bloomberg Euro Aggregate Corporate	125 %	200 %
FoM Euro Corporate Bonds Duration Hedged	ICE BofAML Duration Hedged Euro Corporate	300 %	400 %
FoM North American Equities	MSCI USA TR Net	105 %	120 %
Portfolio Flexible Bonds	50 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 25 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR + 25 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR	150 %	400 %
Portfolio Flexible ESG Bonds	50 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 25 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR + 25 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR	150 %	400 %

<b>Teilfonds</b>	<b>Referenzportfolio*</b>	<b>Erwartetes Engagement</b>	<b>Maximales Engagement</b>
ESG Profile 1 – Very Defensive	80 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % thesaurierter 1-Monats-Euribor	200 %	350 %
ESG Profile 2 – Defensive	20 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10 % MSCI EM TR Net) + 60 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % thesaurierter 1-Monats-Euribor	175 %	300 %
ESG Profile 3 – Moderately Defensive	35 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10 % MSCI EM TR Net) + 45 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % thesaurierter 1-Monats-Euribor	175 %	250 %
ESG Profile 4 – Moderately Aggressive	55 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10 % MSCI EM TR Net) + 25 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % thesaurierter 1-Monats-Euribor	150 %	225 %
ESG Profile 5 – Aggressive	75 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10 % MSCI EM TR Net) + 5 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % thesaurierter 1-Monats-Euribor	125 %	175 %
ESG Profile 6 – Very Aggressive	90 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10 % MSCI EM TR Net) + 10 % thesaurierter 1-Monats-Euribor	105 %	120 %
Comfort Invest II	20 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10 % MSCI EM TR Net) + 60 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % thesaurierter 1-Monats-Euribor	125 %	200 %
Comfort Invest III	35 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10 % MSCI EM TR Net) + 45 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % thesaurierter 1-Monats-Euribor	115 %	150 %
Comfort Invest IV	55 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10 % MSCI EM TR Net) + 25 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % thesaurierter 1-Monats-Euribor	115 %	150 %

<b>Teilfonds</b>	<b>Referenzportfolio*</b>	<b>Erwartetes Engagement</b>	<b>Maximales Engagement</b>
Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Defensief	80 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % thesaurierter 1-Monats-Euribor	125 %	200 %
Verzekeringen Beleggingsfonds Defensief	20 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10 % MSCI EM TR Net) + 60 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % thesaurierter 1-Monats-Euribor	125 %	200 %
Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Defensief	35 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10 % MSCI EM TR Net) + 45 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % thesaurierter 1-Monats-Euribor	125 %	175 %
Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Offensief	55 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10 % MSCI EM TR Net) + 25 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % thesaurierter 1-Monats-Euribor	115 %	150 %
Verzekeringen Beleggingsfonds Offensief	75 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10 % MSCI EM TR Net) + 5 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % thesaurierter 1-Monats-Euribor	110 %	135 %
Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Offensief	90 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10 % MSCI EM TR Net) + 10 % thesaurierter 1-Monats-Euribor	105 %	120 %
Global Balanced	55 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10 % MSCI EM TR Net) + 25 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % thesaurierter 1-Monats-Euribor	120 %	150 %
Flexible Allocation Fund	35 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10 % MSCI EM TR Net) + 45 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % thesaurierter 1-Monats-Euribor	100 %	120 %
Portfolio Global Equities	50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10 % MSCI Emerging Markets TR Net	105 %	120 %
Portfolio Global ESG Equities	MSCI All Countries World TR Net	105 %	120 %
Portfolio High Quality Bonds	Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year	125 %	200 %
Portfolio High Quality ESG Bonds	Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year	125 %	200 %

\* Die Anleger werden auf folgenden Umstand in Bezug auf die Teilfonds in Teil II hingewiesen: Wenn das Portfolio des betreffenden Teilfonds ohne Bezugnahme auf das oben genannte Referenzportfolio erstellt und verwaltet wird, sollte es keine Auswirkungen im Sinne von Artikel 7 Absatz 1 Buchstabe d) der Verordnung (EU) 583/2010 vom 1. Juli 2010 geben.

1.5. Aufstellung der Teilfonds, deren Gesamtengagement auf der Grundlage des VaR-Ansatzes berechnet wird, gegebenenfalls ihre Referenzportfolios und Verschuldungsniveaus (Hebel)

Der erwartete Hebel ist definiert als die Summe des absoluten Werts der Nominalwerte der Derivate (ohne Netting- und Absicherungsvereinbarungen) dividiert durch den NIW (Nominalwertmethode).

Die Möglichkeit höherer Hebelungen im Prospekt: ist das maximale Hebelverhältnis (Nominalwertmethode und Commitment-Methode), das während der Laufzeit des Teilfonds angesichts seiner Anlagepolitik erreicht werden könnte.

Teilfonds	VaR-Ansatz	Referenzportfolio*	Erwarteter Hebel	Maximaler Hebel
RBC BlueBay Euro Government Bonds	Relativ	Bloomberg Euro Treasury 1-10 Year	300 %	1500 %
RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds	Relativ	Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year	300 %	1500 %

\* Die Anleger werden auf folgenden Umstand in Bezug auf die Teilfonds in Teil II hingewiesen: Wenn das Portfolio des betreffenden Teilfonds ohne Bezugnahme auf das oben genannte Referenzportfolio erstellt und verwaltet wird, sollte es keine Auswirkungen im Sinne von Artikel 7 Absatz 1 Buchstabe d) der Verordnung (EU) 583/2010 vom 1. Juli 2010 geben.

1.6. Berechnung des Gegenparteirisikos in Verbindung mit OTC-Finanzderivaten

Gemäß Punkt 4.a) von Anhang 1 des Prospekts darf das Gegenparteirisiko bei Geschäften eines Teilfonds mit OTC-Derivaten 10 % seiner Vermögenswerte nicht überschreiten, wenn die Gegenpartei ein Kreditinstitut im Sinne von Punkt 1.f) von Anhang 1 des Prospekts ist. Für andere Fälle beträgt die Grenze maximal 5 % der Vermögenswerte.

Das mit OTC-Finanzderivaten verbundene Gegenparteirisiko basiert auf dem positiven Marktwert des Kontrakts.

1.7. Bewertung von OTC-Derivaten

Gemäß den Bestimmungen von Anhang 1, Punkt 1.g) des Prospekts sorgt die Verwaltungsgesellschaft für die Einrichtung, Dokumentation, Umsetzung und Wahrung von Maßnahmen und Verfahren, die eine angemessene, transparente und faire Bewertung von OTC-Derivaten sicherstellen.

1.8. Methode der Berechnung des Gesamtmarktengagements für Feeder-Teilfonds

Das Gesamtrisiko eines Feeder-Teilfonds wird berechnet durch Kombination seines eigenen Engagements in Finanzderivaten entweder mit:

- dem tatsächlichen Engagement des Masters in Finanzderivaten im Verhältnis zur Investition des Feeders in den Master; oder
- dem potenziellen maximalen Gesamtengagement des Masters in Finanzderivaten gemäß der Definition im Verwaltungsreglement oder in der Satzung des Masters im Verhältnis zu den Anlagen des Feeders in den Master.

## **2. Bestimmungen für spezifische Instrumente**

Beim Kauf oder Verkauf eines Credit Default Swaps (**CDS**) sichert sich die Gesellschaft gegenüber dem Risiko eines Zahlungsausfalls des Emittenten ab, indem sie eine vierteljährliche Prämie zahlt. Im Falle eines Zahlungsausfalls kann die Zahlung entweder in bar (in diesem Fall erhält der Käufer der Sicherheit den Differenzbetrag zwischen dem Nominalwert und dem wiedererlangbaren Wert) oder in Form von Sacheinlagen erfolgen (in diesem Fall verkauft der Käufer der Sicherheit das in Verzug geratene Wertpapier oder ein anderes Wertpapier aus einem Korb lieferbarer Wertpapiere, die im CDS-Vertrag vereinbart wurden, an den Verkäufer der Sicherheit und erhält so den Nominalwert zurück). Ereignisse, die eine Nichterfüllung darstellen, sind im CDS-Vertrag zusammen mit den Verfahren für die Lieferung der Anleihen und Schuldtitel definiert. Beim Kauf eines Equity Default Swaps (**EDS**) sichert sich die Gesellschaft gegenüber dem Risiko eines starken Rückgangs (die gegenwärtige Marktnorm beträgt 70 %) des Werts des Basiswerts an Aktienmärkten unabhängig von der Ursache des Rückgangs ab, indem sie eine vierteljährliche Prämie bezahlt. Wenn der Absicherungsfall eintritt, d.h. wenn der Schlusskurs am Aktienmarkt den Schwellenwert (von – 70 %) erreicht oder überschreitet, erfolgt die Zahlung in bar: der Käufer der Absicherung erhält einen vorgegebenen Prozentsatz (die aktuelle europäische Marktnorm ist 50 %) des ursprünglich abgesicherten Nennbetrags. Die Gesellschaft kann außerdem einen EDS verkaufen und damit das Risiko eines sinkenden Marktpreises gegen Zahlung einer vierteljährlichen Prämie reproduzieren.

Die Gesellschaft darf nur mit erstrangigen Finanzinstituten handeln, die an diesen Märkten teilnehmen und auf diese Art von Transaktionen spezialisiert sind.

Der Einsatz von CDS und EDS für andere Zwecke als der Absicherung muss folgenden Bedingungen entsprechen:

- sie dürfen ausschließlich im Interesse der Anteilhaber mit dem Ziel eingesetzt werden, unter Berücksichtigung der entstehenden Risiken eine attraktive Rendite zu erzielen;
- die in Anhang 1 definierten allgemeinen Anlagebeschränkungen werden auf den Emittenten der CDS und EDS und auf das Risiko des Endschuldners der CDS und EDS angewendet;
- die Nutzung der CDS und EDS lässt sich mit dem Anlage- und Risikoprofil der betreffenden Teilfonds vereinbaren;
- jeder Teilfonds muss eine jederzeit ausreichende Deckung der Risiken aus den CDS und EDS gewährleisten, um seinen Rücknahmeverpflichtungen gegenüber den Anteilhabern nachkommen zu können, und
- die ausgewählten CDS und EDS sind ausreichend liquide, um den betreffenden Teilfonds den Verkauf/die Glatstellung der fraglichen Kontrakte zum berechneten theoretischen Preis zu erlauben.

**EMTN (Euro Medium Term Notes)** sind mittelfristige Schuldtitel, die durch ihre hohe Flexibilität für den Emittenten (Unternehmen und öffentliche Einrichtungen) und für den Anleger gekennzeichnet sind. EMTN werden gemäß einem EMTN-Programm ausgegeben, d.h. die Nutzung der Kreditfinanzierung kann gestaffelt und die betreffenden Beträge können geändert werden. Der Arrangeur der Emission muss diese nicht notwendigerweise zeichnen, was bedeutet, dass der Emittent sich der vollständigen Aufbringung des angestrebten Betrags nicht sicher sein kann (es liegt daher im Interesse des Emittenten, über eine gute Bonitätsbewertung zu verfügen).

Eine strukturierte EMTN ist die Kombination aus einer EMTN-Emission und einem Derivat mit der Möglichkeit der Konversion der durch die EMTN generierten Cashflows. Wenn beispielsweise der Emittent eine EMTN ausgibt, die LIBOR + Spread zahlt, und gleichzeitig einen LIBOR/Festzins-Swap über denselben Zeitraum eingeht, erhält er den Gegenwert der Festzinsfinanzierung, während der Anleger eine Anlage mit variablem Satz erhält. Diese strukturierten EMTN können von Investmentfonds gezeichnet werden, die ihren Kunden personalisierte Produkte anbieten möchten, die deren spezifischen Bedürfnissen hinsichtlich ihrer Risikoprofile entsprechen.

**Exchange Traded Products (ETP)** ist der Überbegriff, der zur Beschreibung von Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN) und US-Grantor und sonstigen Statutory Trusts verwendet wird. Hierbei handelt es sich um besicherte oder unbesicherte offene strukturierte Wertpapiere, die an einer Börse notiert sind und einen Basiswert nachbilden.

**Commodity ETP** bezieht sich auf alle börsengehandelten Produkte, die Rohstoffrenditen nachbilden. Sie schließen keine ETP ein, die Aktien von Gesellschaften nachbilden, die in der Rohstoffbranche tätig sind.

**Exchange Traded Funds (ETF)** bezieht sich auf börsengehandelte Produkte, die als Investmentfonds oder Organismen für gemeinsame Anlagen strukturiert und reguliert sind:

- **Vereinigte Staaten:** ETF werden im Rahmen des Investment Company Act von 1940 registriert. Derzeit beruhen amerikanische ETF für die Ausgabe und Rücknahme von Wertpapieren auf der physischen Lieferung des Basiswerts;
- **Europäische Union:** Die meisten ETF sind OGAW-konforme Organismen für gemeinsame Anlagen. OGAW-Fonds ist die Anlage in physische Rohstoffe nicht gestattet, sie können jedoch synthetische Indexnachbildungen nutzen, um ein Engagement in breiten Rohstoffindizes zu erreichen, die die entsprechenden Diversifizierungsanforderungen erfüllen;
- **Andere Rechtsordnungen:** Die Schweiz zum Beispiel erlaubt ETF die Verwendung physischer oder synthetischer Nachbildungen, um ein Engagement in Rohstoffen zu erlangen, ohne Diversifizierungsbeschränkungen aufzuerlegen.

**Exchange Traded Commodities (ETCs)** werden wie ETF gehandelt und abgerechnet, sind jedoch als Schuldtitel strukturiert. Sie bilden breite Indizes und Indizes auf einzelne Rohstoffe nach. ETC halten entweder den zugrunde liegenden Rohstoff physisch (z. B. physisches Gold) oder erzielen ihr Engagement über voll besicherte Swaps.

**Exchange Traded Notes (ETN)** sind mit ETC bis auf den Unterschied vergleichbar, dass sie nicht besichert sind, wodurch ein Anleger in eine ETN dem Kreditrisiko des Emittenten voll ausgesetzt ist.

- **Vereinigte Staaten:** Veröffentlichungen über Nettoinventarwert, verwaltetes Vermögen oder ausstehende Anteile täglich.
- **Europa:** Müssen Informationen zu NIW, verwaltetem Vermögen oder umlaufenden Anteilen nicht regelmäßig veröffentlichen und tun dies häufig auch nicht.

„Aktien“-Teilfonds können ihr Vermögen in Aktien und aktienähnliche Wertpapiere investieren. Aktienähnliche Wertpapiere umfassen insbesondere **ADR** und **GDR**, Anlagezertifikate, Bezugsrechtszertifikate und alle sonstigen Wertpapiere, die in der Anlagepolitik genannt werden.

Der Einsatz von ADR/GDR bezieht sich auf alle Kategorien der American Depositary Receipts und Global Depositary Receipts. Bei diesen Zertifikaten handelt es sich um einen Ersatz für Aktien, die aus rechtlichen Gründen nicht lokal erworben werden können. ADR und GDR werden nicht an lokalen Börsen notiert sondern an Märkten wie New York oder London. Sie werden von größeren Banken und/oder Finanzinstituten in Industrieländern im Gegenzug für eine Hinterlegung der Wertpapiere ausgegeben, die in der Anlagepolitik des Teilfonds genannt werden.

### **3. Techniken für eine effiziente Portfolioverwaltung**

Derzeit verwendet die Gesellschaft solche Techniken nicht, und die Gesellschaft darf insbesondere keine Wertpapierleihgeschäfte abschließen. Bei Bedarf wird die Gesellschaft ihren Prospekt bezüglich dieser Techniken aktualisieren, um den in der Verordnung (EU) 2015/2365 vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 und dem CSSF-Rundschreiben 14/592 zu den ESMA-Richtlinien über ETF und anderen OGAW-Fragen aufgeführten Vorschriften zu entsprechen.

Wenn die Gesellschaft außerbörsliche Finanzderivate einsetzt, muss sie sicherstellen, dass alle zur Reduzierung des Kontrahentenrisikos verwendeten Sicherheiten jederzeit die folgenden Kriterien erfüllen:

- Liquidität** – Erhaltene Sicherheiten (außer Barmitteln) sollten hochliquide sein und auf einem geregelten Markt oder über eine multilaterale Handelseinrichtung mit transparenten Preisen gehandelt werden, damit sie schnell zu einem Preis nahe der Bewertung vor dem Verkauf verkauft werden können. Erhaltene Sicherheiten müssen zudem die Bestimmungen von Artikel 56 der Richtlinie 2009/65/EG erfüllen.
- Bewertung** – Erhaltene Sicherheiten müssen mindestens auf täglicher Basis bewertet werden können und Vermögenswerte, die eine hohe Kursvolatilität aufweisen, dürfen nicht als Sicherheiten akzeptiert werden, es sei denn, es werden angemessene konservative Sicherheitsabschläge vorgenommen.
- Emittentenbonität** – Die entgegengenommenen Sicherheiten müssen von hoher Qualität sein.
- Korrelation** – die von der Gesellschaft erhaltenen Sicherheiten müssen von einer Einrichtung ausgegeben werden, die von der Gegenpartei unabhängig ist und von der keine hohe Korrelation zur Performance der Gegenpartei erwartet wird.
- Diversifizierung der Sicherheiten (Vermögenskonzentration)** – Sicherheiten müssen im Hinblick auf Länder, Märkte und Emittenten ausreichend diversifiziert sein. Das Kriterium ausreichender Diversifizierung im Hinblick auf die Emittentenkonzentration wird als erfüllt angesehen, wenn die Gesellschaft von einer Gegenpartei von Geschäften zum Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung und OTC-Derivategeschäften einen Sicherheitenkorb erhält, bei dem das maximale Engagement in einem einzelnen Emittenten 20 % seines NIW nicht übersteigt. Wenn die Gesellschaft verschiedenen Gegenparteien ausgesetzt ist, werden die verschiedenen Sicherheitenkörbe zusammengefasst, um eine Expositionsgrenze von 20 % für einen einzelnen Emittenten zu berechnen. Abweichend von diesem Unterabsatz kann sich die Gesellschaft vollständig absichern durch die Anlage in verschiedenen übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten, die von einem Mitgliedstaat, einer oder mehreren seiner lokalen Behörden, einem Drittland oder einer öffentlichen, internationalen Körperschaft, zu der ein oder mehrere Mitgliedstaaten gehören, ausgegeben oder garantiert werden. In diesem Fall erhält die Gesellschaft Wertpapiere aus mindestens sechs verschiedenen Emissionen, wobei die Wertpapiere jeder einzelnen Emission nicht mehr als 30 % des NIW der Gesellschaft darstellen dürfen. Strebt die Gesellschaft eine vollständige Besicherung durch Wertpapiere an, die von einem Mitgliedstaat ausgegeben oder garantiert werden, ist diese Tatsache im Prospekt offenzulegen. Darüber hinaus muss die Gesellschaft in ihrem Prospekt die Mitgliedstaaten, die lokalen Behörden oder die öffentlichen, internationalen Körperschaften ausweisen, die Wertpapiere ausgeben oder garantieren, die sie als Sicherheit für mehr als 20 % ihres NIW akzeptiert.
- Risiken in Verbindung mit der Verwaltung von Sicherheiten**, z.B. operative und rechtliche Risiken, müssen durch den Risikomanagementprozess der Verwaltungsgesellschaft identifiziert, verwaltet und gemindert werden.
- Bei einer Titelübertragung muss die erhaltene Sicherheit bei der Verwahrstelle hinterlegt werden. Bei anderen Arten von Sicherheitsvereinbarungen kann die Sicherheit bei einer dritten Verwahrstelle hinterlegt werden, die einer ordentlichen Aufsicht unterliegt und die in keiner Verbindung zum Sicherheitengeber steht.
- Die erhaltene Sicherheit muss von der Gesellschaft jederzeit ohne Verweis auf oder Genehmigung durch die Gegenpartei vollständig einforderbar sein.
- Erhaltene unbare Sicherheiten dürfen nicht verkauft, reinvestiert oder verpfändet werden.
- Barsicherheiten müssen nur wie folgt verwendet werden:
  - als Einlage bei Rechtssubjekten gemäß Artikel 50(f) der Richtlinie 2009/65/EG;
  - als Anlage in hochwertigen Staatsanleihen;
  - zum Zwecke umgekehrter Pensionsgeschäfte, sofern die Geschäfte mit Kreditinstituten getätigt werden, die einer ordentlichen Aufsicht unterliegen, und die Gesellschaft in der Lage ist, den kompletten aufgelaufenen Betrag an Barmitteln jederzeit abzurufen;
  - als Anlage in kurzfristigen Geldmarktfonds.

In diesem Fall wird die Gesellschaft eine deutliche Sicherheitsabschlagsrichtlinie einrichten, die für jede als Sicherheit erhaltene Vermögenswertekategorie angepasst wird, und bei der Ausarbeitung der Sicherheitsabschlagsrichtlinie wird die Gesellschaft die Eigenschaften der Vermögenswerte, wie z. B. die Kreditwürdigkeit und/oder die Kursvolatilität, sowie das Ergebnis der Stresstests berücksichtigen. Die Gesellschaft wird sicherstellen, dass diese Richtlinie dokumentiert wird und jede Entscheidung zur Anwendung oder

Nichtanwendung eines Sicherheitsabschlags auf eine bestimmte Anlagenklasse rechtfertigen. Die Richtlinien der Gesellschaft für Sicherheiten und Sicherheitsabschläge werden im Prospekt offengelegt.

#### 4. Auswahlverfahren für nachhaltige/ESG-Anlagen

Im Einklang mit den UN PRI schließt die Verwaltungsgesellschaft Direktanlagen in Wertpapieren aus, die von Unternehmen ausgegeben werden, die an sehr umstrittenen Aktivitäten beteiligt sind (z. B. der Produktion von Tabak oder umstrittenen Waffen) und/oder schwerwiegend gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen (Unternehmen mit Nichteinhaltungsstatus). Diese Ausschlussregel, die Schutzmaßnahmen im Hinblick auf Umwelt und Soziales und Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung umfasst, gilt für alle Teilfonds (einschließlich Teilfonds, die nicht als Anlageprodukte gemäß Artikel 8 oder 9 der Offenlegungsverordnung eingestuft sind) und deren Direktanlagen.

Die Teilfonds, die unter Artikel 8 und 9 der Offenlegungsverordnung fallen, wenden zusätzlich zu den UN PRI und dem Global Compact der Vereinten Nationen einen Ansatz hinsichtlich Umwelt, Sozialem und Unternehmensführung an, der auf der Kombination von Ausschlussregeln, ESG-Screening und Engagement-Aktionen (wenn dies als notwendig erachtet wird und anwendbar ist) basiert:

Die Verwaltungsgesellschaft hat verschiedene Stufen des ESG-Engagements wie folgt definiert:

Kategorie der Offenlegungsverordnung	Interne Kategorie	Grad des ESG-Engagements
Art.9	Art.9	Hoch
Art.8	Art.8+	Hoch
Art.8	Art. 8	Mittel
Art.6	Art.6	Niedrig/Nicht zutreffend

Die Verwaltungsgesellschaft hat verschiedene Ausschlüsse für Direktinvestitionen definiert, die im Folgenden aufgeführt sind:

#### UNTERNEHMEN

Ausgeschlossene(r) Aktivität/Sektor <sup>1</sup>	Umsatzschwellenwert	Art.6	Art.8	Art.8+	Art.9 <sup>2</sup>
Umstrittene Waffen	0 %	X	X	X	X
UN Global Compact, nicht konforme Unternehmen	Keine Toleranz	X	X	X	X
Waffenproduktion – militärische Aufträge (Rüstung) – Kleine militärische und zivile Waffen	0 % außer für militärische Aufträge und für Produkte und/oder Dienstleistungen im Zusammenhang mit Waffen (Schwellenwert: 5 %)	-	-	X	X
Tabakproduktion (Landwirte und Hersteller)	0 %	X	X	X	X
Glücksspiel	5 %	-	-	X	X
Erwachsenenunterhaltung (z. B. Pornografie)	5 %	-	-	X	X
Tierpelze und Lederwaren	5 %	-	-	X	X
GVO-Pflanzen und -Saatgut	5 %	-	-	X	X
Tierversuche	Qualitative Bewertung (Sicherstellen, dass die gesetzlich vorgeschriebenen Verfahrensweisen den branchenüblichen Standards entsprechen)	-	-	X	X
Cannabis für nicht-medizinische Zwecke	5 %	-	-	X	X
Bohrungen in der Arktis, Gas- und Ölsandgewinnungsmethoden	5 %	-	-	X	X
Erzeugung/Gewinnung von Kraftwerkskohle	5 %	-	-	X	X
	10 %	-	X	-	-
Erzeugung von elektrischem Strom aus Kraftwerkskohle	10 %	-	X	X	X
Handel und/oder Großhandel mit Tabakwaren (einschl. Einzelhandel)	50 %	-	-	X	X

- Die Liste der Ausschlüsse und die Umsatzschwellenwerte können sich verändern
- Einige Teilfonds (Art.9) können gezielt von den Ausschlussregeln abweichen.

Mindestabdeckung der Nachhaltigkeitsanalyse	Art.6	Art.8	Art.8+	Art.9
% der Wertpapiere im Portfolio (*)	Kein Minimum	70 %	90 %	90 %

(\*) ausgenommen Barmittel, Einlagen und Derivate

Darüber hinaus zielen die Fonds gemäß Artikel 8 darauf ab, dass der ESG-Score eines Portfolios über dem ESG-Score des Anlageuniversums/der Benchmark liegt.

Normenbasierte Ausschlüsse		Art.6	Art.8	Art.8+	Art.9
Länder, die gegen internationale Normen verstoßen und mit internationalen Sanktionen belegt sind		X	X	X	X
Länder, die die folgenden Verträge nicht ratifiziert haben	den Atomwaffensperrvertrag	-	X	X	X
	das Klimaabkommen von Paris (2015)	-	X	X	X
	das ILO-Übereinkommen 182 zur Abschaffung der schlimmsten Formen der Kinderarbeit	-	X	X	X

Die Ausschlüsse können sich im Laufe der Zeit (ohne vorherige Ankündigung) ändern und die Anlageprodukte können strengere Schwellenwerte und/oder zusätzliche Ausschlüsse berücksichtigen. Die neueste Version der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft ist auf ihrer Website verfügbar.

Die Klassifizierung der Teilfonds, die auf der eigenen Einschätzung der Verwaltungsgesellschaft beruht, ist in einer speziellen Tabelle auf der letzten Seite des Prospekts zusammengefasst.

#### Integration von Nachhaltigkeitsrisiken in das Anlageverfahren

Hinsichtlich der Integration von Nachhaltigkeitsrisiken in die Anlageentscheidungen der Teilfonds unterscheidet die Verwaltungsgesellschaft zwischen einem Satz von Ausschlüssen und der Integration von ESG-Themen sowie individuellen Ansätzen bestimmter externer Anlageverwalter der Teilfonds.

Für jeden Teilfonds gemäß Artikel 8 und 9 ist im Sonderteil des Verkaufsprospekts die Methode angegeben, mit der die Teilfondsverwaltung Nachhaltigkeitsrisiken bei ihren Anlageentscheidungen berücksichtigt. Teilfonds gemäß Artikel 8 und 9 berücksichtigen das Nachhaltigkeitsrisiko, wie von der Verwaltungsgesellschaft definiert, und können zusätzliche Screenings des Anlageverwalters verwenden.

Teilfonds gemäß Artikel 6 berücksichtigen Nachhaltigkeitsrisiken, da sie die Mindestausschlussregeln der Verwaltungsgesellschaft umsetzen (Vermeidung von Anlagen in Unternehmen mit den schlechtesten Praktiken in Bezug auf Unternehmensführung, Umwelt, soziale Belange und Menschenrechte sowie in umstrittenen Aktivitäten, die als erhebliche negative Auswirkungen auf die Nachhaltigkeit habend eingestuft werden); die zugrunde liegenden Anlagen der Teilfonds gemäß Artikel 6 der Offenlegungsverordnung berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige wirtschaftliche Aktivitäten.

**Engagement:** bezeichnet die Verantwortung des Portfoliomanagers, da die spezifischen Engagementziele von der Anlagestrategie des Teilfonds und der Gewichtung von ESG-Kriterien abhängen. Ein Teilfonds, der einen Beitrag zur Reduzierung von Treibhausgasen leisten will, kann sich bei den Portfoliounternehmen auf andere Weise engagieren als ein Teilfonds, der sich auf Menschenrechte konzentriert. Darüber hinaus kann sich ein Teilfonds, der einen Value-Ansatz verfolgt, auf eine andere Weise engagieren als ein Teilfonds, der einen auf Wachstum ausgerichteten Ansatz verfolgt. Die Anlageverwalter erstatten der Verwaltungsgesellschaft jährlich Bericht über ihre Engagementbemühungen.

**Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor:** Nach dem Inkrafttreten der Verordnung (EU) Nr. 2022/1288 vom 6. April 2022 zur Ergänzung der Offenlegungsverordnung im Hinblick auf technische Regulierungsstandards wird die Verwaltungsgesellschaft die Informationen veröffentlichen, die:

- den Inhalt und die Offenlegung von Informationen in Bezug auf die Bewertung ökologischer oder sozialer Merkmale und/oder nachhaltiger Anlageziele spezifizieren
- den Inhalt, die Methoden und die Offenlegung von Informationen in Bezug auf Nachhaltigkeitsindikatoren und nachteilige Auswirkungen auf die Nachhaltigkeit spezifizieren,
- den Inhalt und die Offenlegung von Informationen in Bezug auf den Grundsatz „keinen erheblichen Schaden verursachen“ in vorvertraglichen Dokumenten, auf Websites und in periodischen Berichten spezifizieren.

**Bestimmungen zum Referenzindex gemäß der Offenlegungsverordnung:** Die Verordnung verpflichtet die Verwaltungsgesellschaft, gegenüber den Anlegern offenzulegen, inwieweit der Referenzindex des Teilfonds ESG-Kriterien oder E/S-Ziele (ökologische oder soziale Ziele) verfolgt. Die im Verkaufsprospekt angegebenen breitgefächerten Referenzindizes berücksichtigen keine ESG-Kriterien oder -Ziele.

---

## ANHANG 3 – ANLAGERISIKEN

---

Potenzielle Anleger werden gebeten, vor einer Anlage den gesamten Prospekt sorgfältig zu lesen. Anlagen können auch von Änderungen der Vorschriften zu Wechselkurskontrollen, Besteuerung und Quellensteuerabzug sowie bezüglich Wirtschafts- und Geldpolitik beeinträchtigt werden.

Darüber hinaus werden Anleger darauf hingewiesen, dass die Performance der Teilfonds möglicherweise nicht mit dem angegebenen Anlageziel übereinstimmt und dass ihr angelegtes Kapital (abzüglich der Zeichnungsgebühren) möglicherweise nicht vollständig zurückerstattet werden kann.

Die Teilfonds unterliegen in Abhängigkeit von ihrer Anlagepolitik unterschiedlichen Risiken. Die Hauptrisiken, denen Teilfonds wahrscheinlich ausgesetzt sind, sind im Folgenden aufgeführt.

Einige Teilfonds können besonders empfindlich auf ein oder mehrere spezifische Risiken reagieren. Im Gegensatz zu anderen Teilfonds, die nur auf allgemeine Risiken reagieren, können sie dadurch erhöhte Risikoprofile aufweisen; in solchen Fällen werden die Risiken ausdrücklich in Teil II genannt.

### **Kreditrisiko**

*Dieses Risiko trägt jeder Teilfonds, der Schuldverschreibungen in seinem Anlageuniversum führt.*

Dies ist das Risiko, das aus der Herabstufung oder dem Ausfall eines Anleiheemittenten resultieren kann, in dem die Teilfonds Positionen halten, was somit einen Rückgang des Wertes der Anlagen zur Folge haben kann. Diese Risiken beziehen sich auf die Fähigkeit eines Emittenten, seine Schulden zu begleichen.

Die Herabstufungen des Ratings einer Emission oder eines Emittenten können zu einem Wertverlust der Anleihen führen, in die der Teilfonds angelegt ist.

Manche der eingesetzten Strategien können auf Anleihen basieren, die von Emittenten mit einem überdurchschnittlich hohen Kreditrisiko ausgegeben werden (High Yield-Anleihen).

### **Liquiditätsrisiko**

*Dieses Risiko kann möglicherweise alle Finanzinstrumente betreffen und daher einen oder mehrere Teilfonds gleichzeitig beeinflussen.*

Es besteht das Risiko, dass die vom Teilfonds getätigten Anlagen illiquide werden können. Demzufolge wird es eventuell nicht möglich sein, diese Anlagen innerhalb des gewünschten Zeithorizonts und zu einem fairen Marktpreis zu kaufen oder zu verkaufen, was sich negativ auf diese Teilfonds auswirken kann.

Die notleidenden Vermögenswerte, die in Teil II erwähnt werden, unterliegen einem hohen Liquiditätsrisiko.

### **Gegenpartierisiko**

Dieses Risiko besteht im Zusammenhang mit dem Engagement der Teilfonds in finanzielle Gegenparteien beim Abschluss von außerbörslichen Verträgen. Es stellt das Verlustrisiko aufgrund des Versäumnisses einer Gegenpartei zur Erfüllung ihrer Verpflichtungen dar (beispielsweise in Bezug auf Zahlung, Lieferung und Rückzahlung).

### **Operatives- und Verwahrnisiko**

Manche Märkte sind weniger reguliert als die meisten internationalen Märkte; daher können mit der Verwahrung und Liquidation verbundene Dienstleistungen für die Fonds auf diesen Märkten riskanter sein.

### **Derivatrisiko**

Zu Absicherungszwecken (Strategie der Verwendung von Derivaten zu Absicherungszwecken) und/oder um die Rendite seines Portfolios zu optimieren (Strategie der Verwendung von Derivaten zu Anlagezwecken) sind Teilfonds berechtigt, gemäß den in Anhang 1 und 2 des Prospekts beschriebenen Bedingungen auf derivative Techniken und Instrumente zurückzugreifen (insbesondere Tauschverträge auf Wertpapiere, Zinsen, Währungen, Inflation, Volatilität und andere derivative Finanzinstrumente, Credit Default Swaps (CDS), Finanztermingeschäfte, Optionen auf Wertpapiere, Zinsen oder Terminkontrakte usw.).

Der Anleger wird auf die Tatsache aufmerksam gemacht, dass Absicherungsstrategien möglicherweise nicht wirksam sind und nicht ihren vorgesehenen Zweck erfüllen, und dass Handelsstrategien eine Hebelung beinhalten und demzufolge die Volatilität dieser Teilfonds erhöhen können. Demzufolge können diese Teilfonds durch solche derivativen Anlagestrategien negativ beeinflusst werden.

### **Risiko hoher Hebelung**

Ein leichter Preisrückgang bei einem „gehebelten“ Vermögensportfolio wird der Gesellschaft dementsprechend einen viel höheren Verlust bescheren. Eine hohe Gesamthebelung und/oder ungewöhnliche Marktbedingungen können zu erheblichen Verlusten für die Gesellschaft führen.

### **Synthetische Risiken aus Leerverkäufen**

Die Gesellschaft kann einem Risiko ausgesetzt sein, dass mit dem Risiko synthetischer Leerverkäufe gleichzusetzen ist. Solche fiktiven Leerverkäufe sind mit Kosten und Risiken verbunden. Wenn ein leerverkauftes Wertpapier im Preis steigt, muss die Gesellschaft möglicherweise ihr kurzfristiges Engagement zu einem höheren Preis als dem Leerverkaufspreis ausbuchen, was zu einem Verlust führt. Die Gesellschaft ist möglicherweise nicht in der Lage, ihr Engagement in Short-Positionen zu einem akzeptablen Preis zu schließen, und muss eventuell Long-Positionen früher als geplant verkaufen. Da der Verlust der Gesellschaft aufgrund des Engagements in Short-Positionen durch die Wertsteigerung des Wertpapiers verursacht wird, ist ein derartiger Verlust theoretisch unbegrenzt. In bestimmten Fällen kann der spekulative Erwerb eines Wertpapiers zur Abdeckung einer Short-Position selbst zum weiteren Anstieg des Wertpapierkurses führen und dadurch den Verlust noch erhöhen.

### **Risiko von Aktienmärkten**

*Dieses Risiko trägt jeder Teilfonds, der Aktien in seinem Anlageuniversum führt.*

Die mit Anlagen in Aktien (und ähnlichen Instrumenten) verbundenen Risiken schließen wesentliche Preisschwankungen, negative Informationen über den Emittenten oder den Markt und die Nachrangigkeit der Aktien einer Gesellschaft gegenüber ihren Anleihen ein. Darüber hinaus werden diese Schwankungen häufig kurzfristig verstärkt. Der Wert von Teilfonds, die in Aktienmärkten anlegen, kann durch diese Anlagen negativ beeinflusst werden.

Gewisse Teilfonds können in Erstemissionen (Initial Public Offering, „IPO“) investieren. In diesem Fall besteht ein Risiko, dass der Preis des neu ausgegebenen Anteils aufgrund von Faktoren wie dem Fehlen eines öffentlichen Marktes, nicht zeitgemäßer Transaktionen, der



begrenzten Anzahl handelbarer Wertpapiere und fehlender Informationen über den Emittenten einer höheren Volatilität ausgesetzt ist. Ein Teilfonds hält derartige Titel unter Umständen nur für eine kurze Zeit, was eine Erhöhung der Kosten zur Folge hat.

### **Zinsrisiko**

*Dieses Risiko trägt jeder Teilfonds, der Schuldverschreibungen in seinem Anlageuniversum führt.*

Der Wert einer Anlage kann durch Schwankungen der Zinssätze beeinträchtigt werden. Zinssätze können von verschiedenen Faktoren oder Ereignissen wie der Geldpolitik, dem Diskontsatz, der Inflation usw. beeinflusst werden.

Anleger werden darauf hingewiesen, dass ein Anstieg der Zinssätze zu einem Wertverfall von Anlagen in Anleihen und Schuldtiteln führt.

### **Folgen niedriger Zinssätze**

*Dieses Risiko trägt jeder Teilfonds, der Schuldverschreibungen in seinem Anlageuniversum führt.*

Ein sehr niedriges Zinsniveau kann die Erträge von durch Geldmarktfonds gehaltenen Vermögenswerten mit kurzer Laufzeit beeinträchtigen, welche in diesem Fall möglicherweise nicht die Verwaltungskosten decken und zu einer strukturellen Verringerung des NIW des Teilfonds führen.

### **Wechselkursrisiko**

*Dieses Risiko trägt jeder Teilfonds, der Positionen in anderen Währungen als seiner Rechnungswährung in seinem Bestand führt.*

Ein Teilfonds kann Vermögenswerte halten, die auf andere Währungen als seine Rechnungswährung lauten. Er kann von jeder Schwankung der Wechselkurse zwischen seiner Rechnungswährung und diesen anderen Währungen oder durch eine eventuelle Änderung hinsichtlich der Wechselkurskontrollen beeinflusst werden. Wenn die Währung, auf die ein Titel lautet, im Vergleich zur Rechnungswährung des Teilfonds im Wert steigt, steigt auch der Gegenwert des Titels in dieser Rechnungswährung. Umgekehrt führt ein Wertverlust dieser Währung zu einem niedrigeren Gegenwert des Titels.

Wenn der Verwalter zur Absicherung des Wechselkursrisikos einer Transaktion bereit ist, besteht keine Garantie, dass diese Maßnahme vollständig wirksam sein wird.

### **Inflationsrisiko**

*Von diesem Risiko sind alle Arten von Anlagen betroffen.*

Im Laufe der Zeit halten die Renditen kurzfristiger Anlagen möglicherweise nicht mit der Inflation Schritt, was zu einer sinkenden Kaufkraft einer Anlage führt.

### **Steuerisiko**

*Dies ist ein allgemeines Risiko.*

Der Wert einer Anlage kann durch die Anwendung der unterschiedlichen Steuergesetzgebungen der einzelnen Länder, einschließlich der Quellensteuer, einen Regierungswechsel sowie die Änderung der Wirtschafts- oder Geldpolitik in den betroffenen Ländern beeinträchtigt werden. Dementsprechend kann nicht gewährleistet werden, dass die finanziellen Ziele tatsächlich erreicht werden.

### **Risiko von Rohstoffmärkten (einschließlich Risiko des Goldmarktes)**

*Dieses Risiko trägt jeder Teilfonds, der Rohstoffe (in Form indirekter Anlagen) in seinem Anlageuniversum führt.*

Rohstoffmärkte können plötzliche und starke Kursschwankungen aufweisen, die sich unmittelbar auf die Bewertung von Aktien und aktienähnlichen Titeln, in die ein Teilfonds anlegt, und/oder auf Indizes, in denen ein Teilfonds engagiert ist, auswirken.

Darüber hinaus kann die Entwicklung der Basiswerte deutlich von klassischen Wertpapiermärkten (Aktienmärkte, Anleihemärkte etc.) abweichen.

### **Risiko von Schwellenmärkten**

Bei Teilfonds, die in Schwellenmärkten anlegen, besteht die Wahrscheinlichkeit einer überdurchschnittlichen Volatilität aufgrund einer höheren Konzentration, größerer Unsicherheit wegen weniger verfügbarer Informationen, geringerer Liquidität oder höherer Empfindlichkeit gegenüber Änderungen bei den Marktbedingungen (gesellschaftliche, politische und wirtschaftliche Bedingungen). Zusätzlich bieten manche Schwellenmärkte weniger Sicherheit als die Mehrheit der internationalen entwickelten Märkte. Aus diesem Grund bergen mit Portfoliotransaktionen, Liquidation und Verwahrung verbundene Dienstleistungen für Fonds, die in Schwellenmärkten investiert sind, ein größeres Risiko. Demzufolge kann der Wert von Teilfonds, die in Schwellenmärkten anlegen, durch diese Anlagen negativ beeinflusst werden. Die Gesellschaft und die Anleger erklären sich zur Übernahme dieser Risiken bereit.

Im Hinblick auf den russischen Markt erfolgen Anlagen über die Russian Trading System Stock Exchange (oder „RTS Stock Exchange“), die eine große Anzahl russischer Emittenten vereint und fast eine gesamte Abdeckung des russischen Aktienuniversums ermöglicht. Durch Anlagen an der RTS Stock Exchange profitieren Anleger von der Liquidität des russischen Marktes, ohne in der lokalen Währung handeln zu müssen, da alle Emittenten direkt in USD gehandelt werden können.

### **ESG-Risiken**

*Aufgrund fehlender Standards für ESG-Kriterien kann der Vergleich zwischen verschiedenen Portfolios anhand dieser Kriterien erschwert werden.*

Bei der Auswahl von Wertpapieren kann die Anwendung von ESG-Filtern sehr subjektiv sein. Aufgrund fehlender Standards hinsichtlich ESG-Kriterien und -Unterkriterien können die in die Anlageprozesse einbezogenen ESG-Faktoren je nach Anlagethema, Anlageklasse, Anlagephilosophie und subjektiver Anwendung verschiedener ESG-Kriterien und -Unterkriterien für die Portfoliokonstruktion variieren.

*Die am Markt verfügbaren ESG-Anlagestrategien werden möglicherweise unterschiedlich interpretiert.*

Das ständige implizite Risiko ist das „Greenwashing“ des Portfolios, d. h. einige Wertpapierfirmen nutzen ESG für Vermarktungszwecke, statt eine ehrliche ESG-Anlagestrategie zu verfolgen.

*Die Wertentwicklung von Teilfonds, die ESG-Kriterien verwenden, kann sehr unterschiedlich ausfallen.*

Die Anwendung von ESG-Kriterien kann sich auf die Anlageperformance der Teilfonds auswirken, d. h. die Wertentwicklung der Teilfonds kann im Vergleich zu ähnlichen Teilfonds, die diese Kriterien nicht anwenden, abweichen. Tatsächlich unterscheiden sich die Auswahlprozesse für Anlagen aufgrund von ESG-Kriterien.

*Die Weiterentwicklung der ESG-Risikoberechnungen erschwert die ESG-Risikomessung.*

Da sich die Bewertung von ESG-Risiken noch in der Entwicklung befindet, ist es in der Regel schwierig, ESG-Risiken direkt als traditionelle Risiken zu messen. Die Verwaltungsgesellschaft muss daher die Risiken des Fonds auf der Grundlage indirekter Risikomaße managen, wie z. B. die (relativen) Scores der Unternehmen in Bezug auf die große Anzahl von ESG-Faktoren, die über Datenanbieter auf dem Markt verfügbar sind.

### **Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten**

Bei Teilfonds, die in Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung oder in spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten anlegen, besteht die Wahrscheinlichkeit einer überdurchschnittlichen Volatilität aufgrund einer höheren Konzentration, größerer Unsicherheit aufgrund weniger verfügbarer Informationen, geringerer Liquidität oder höherer Empfindlichkeit gegenüber Änderungen der Marktbedingungen. Diese Anlagen können sich negativ auf den Wert dieser Teilfonds auswirken.

### **Risiko von Optionsscheinen**

Die Anleger werden darauf hingewiesen, dass Optionsscheine komplexe, volatile Instrumente mit hohem Risiko sind: Das Risiko eines Totalverlusts des investierten Kapitals ist hoch. Zusätzlich besteht eine der wesentlichen Eigenschaften von Optionsscheinen in der „Hebelwirkung“, die sich dadurch bemerkbar macht, dass eine Wertänderung des Basiswertes eine unverhältnismäßige Auswirkung auf den Wert des Optionsscheins haben kann. Schließlich besteht keine Garantie, dass es im Falle eines illiquiden Marktes möglich ist, den Optionsschein auf einem Sekundärmarkt zu verkaufen.

### **Risiken in Verbindung mit Anlagen in bestimmten Ländern**

Anlagen in bestimmten Ländern (China, Indien, Indonesien, Japan, Saudi-Arabien und Thailand) bergen Risiken, die aus den für ausländische Anleger und Gegenparteien geltenden Beschränkungen, der höheren Marktvolatilität sowie dem Risiko resultieren, dass bestimmte Positionen des Portfolios nicht liquide sein könnten. Folglich können bestimmte Aktien für den Teilfonds möglicherweise nicht verfügbar sein, weil die zulässige Anzahl ausländischer Aktionäre oder die Obergrenze der für ausländische Aktionäre zulässigen Anlagen erreicht wurde. Außerdem kann die Rückführung des Anteils ausländischer Anleger an Reingewinn, Kapital und Dividenden ins Ausland Beschränkungen unterliegen oder eine staatliche Genehmigung erfordern. Die Gesellschaft tätigt Anlagen nur dann, wenn sie die Beschränkungen für akzeptabel hält. Es kann jedoch nicht gewährleistet werden, dass zukünftig keine zusätzlichen Beschränkungen erlassen werden.

### **Spezifische Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in China**

Risiken in Verbindung mit Shenzhen und Shanghai-Hong Kong Stock Connect

#### *Risiko durch Quotenbeschränkungen*

Stock Connect unterliegt Quotenbeschränkungen auf Anlagen, die die Fähigkeit des Teilfonds, termingerecht über Stock Connect zu investieren, einschränken können, und der Teilfonds kann möglicherweise seine Anlagepolitik nicht effektiv verfolgen.

#### *Aussetzungsrisiko*

Sowohl die Hong Kong Stock Exchange („SEHK“) als auch die Shanghai Stock Exchange („SSE“) behalten sich das Recht vor, den Handel auszusetzen, falls dies für die Sicherstellung eines ordentlichen und fairen Markts und zum umsichtigen Risikomanagement erforderlich ist, was den Zugang des jeweiligen Teilfonds zum Markt der Volksrepublik China („VRC“) beeinträchtigen würde.

#### *Unterschiedliche Handelstage*

Stock Connect ist nur an Tagen in Betrieb, an denen die Märkte sowohl in der VR China als auch in Hongkong für den Handel und die Banken auf beiden Märkten an den entsprechenden Abwicketagen geöffnet sind. Es kann also vorkommen, dass Anleger in Hongkong an einem normalen Handelstag in der VRC nicht handeln können. Die Teilfonds können einem Risiko von Kursschwankungen während des Zeitraums unterliegen, in dem an der Stock Connect nicht gehandelt wird.

#### *Verkaufseinschränkungen durch das Front-End-Monitoring*

Gesetze in der VRC sehen vor, dass ein Anleger Aktien nur dann verkaufen darf, wenn sich ausreichend Aktien auf dem Konto befinden. Andernfalls wird der betreffende Verkaufsauftrag von der SSE abgelehnt. Die SEHK wird Verkaufsaufträge ihrer Teilnehmer (d. h. Börsenmakler) vor der Handelstätigkeit überprüfen, um einen Überverkauf zu vermeiden.

#### *Clearing-, Abwicklungs- und Verwahr Risiken*

Die Hong Kong Securities Clearing Company Limited, eine hundertprozentige Tochtergesellschaft von HKEx („HKSCC“), und China Securities Depository and Clearing Corporation Limited („ChinaClear“) stellen die Clearing-Verbindung her, wobei jeder ein Teilnehmer des jeweils anderen ist, um das Clearing und die Abwicklung von grenzüberschreitenden Handelsgeschäften zu ermöglichen. Als nationale zentrale Gegenpartei des Wertpapiermarktes der VRC betreibt ChinaClear ein umfassendes Infrastrukturnetzwerk für Clearing, Abwicklung und Wertpapierbestände. ChinaClear hat ein Rahmenwerk und Maßnahmen für das Risikomanagement eingerichtet, die von der CSRC genehmigt wurden und beaufsichtigt werden. Die Möglichkeit eines Zahlungsausfalls von ChinaClear wird als geringfügig angesehen. Für den sehr unwahrscheinlichen Fall eines Zahlungsausfalls von ChinaClear und einer Erklärung von ChinaClear zum Schuldner wird HKSCC nach Treu und Glauben die Wiedererlangung der ausstehenden Aktien und Gelder von ChinaClear über die zur Verfügung stehenden rechtlichen Kanäle oder durch die Liquidation von ChinaClear anstreben. In diesem Fall kann sich der Rückerstattungsprozess für den Fonds verzögern oder er erhält möglicherweise seine Verluste von ChinaClear nicht vollständig zurück.

Die über Shenzhen-Hong Kong oder Shanghai-Hong Kong Stock Connect gehandelten Aktien werden in papierloser Form ausgegeben, d. h. Anleger wie die Teilfonds, halten keine physischen Aktien. Anleger aus Hongkong und ausländische Anleger, wie die Teilfonds, die über den Northbound-Handel SSE-Wertpapiere erworben haben, sollten die SSE-Wertpapiere auf den Aktienkonten ihrer Makler oder Verwahrstellen beim Central Clearing and Settlement System halten, das von der HKSCC für das Clearing der an der SEHK notierten oder gehandelten Wertpapiere betrieben wird. Weitere Informationen zur Verwahrung in Verbindung mit Stock Connect sind auf Anfrage am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft erhältlich.

#### *Operatives Risiko*

Stock Connect bietet eine neue Möglichkeit für Anleger aus Hongkong und dem Ausland, wie der Teilfonds, direkten Zugang zum chinesischen Aktienmarkt zu erhalten. Stock Connect beruht auf der Funktionsweise der technischen Systeme der entsprechenden Marktteilnehmer. Marktteilnehmer können an diesem Programm teilnehmen, wenn sie bestimmte Anforderungen in Bezug auf Informationstechnologie, Risikomanagement und sonstige Faktoren erfüllen, die von der jeweiligen Börse und/oder Clearingstelle festgelegt werden.

Es sollte beachtet werden, dass sich die Wertpapierregelungen und Rechtssysteme der beiden Märkte erheblich voneinander unterscheiden. Damit das Testprogramm funktioniert, müssen Marktteilnehmer daher fortlaufend mit Problemen rechnen, die sich aus diesen Unterschieden ergeben.

Außerdem erfordert die „Konnektivität“ der Stock Connect-Programme die grenzüberschreitende Weiterleitung von Aufträgen. Dies erfordert die Entwicklung neuer Informationstechnologiesysteme seitens der SEHK und der teilnehmenden Börsen (d. h. eines neuen, von der SEHK einzurichtenden Order-Routing-Systems [„China Stock Connect System“], an das sich die teilnehmenden Börsen anschließen müssen). Es kann nicht garantiert werden, dass die Systeme der SEHK und der Marktteilnehmer ordnungsgemäß funktionieren oder fortlaufend den Änderungen und Entwicklungen dieser beiden Märkte angepasst werden. Wenn die entsprechenden Systeme nicht ordnungsgemäß arbeiten, könnte der Handel über das Programm in beiden Märkten unterbrochen werden. Die Möglichkeit des Teilfonds, auf den Markt der A-Aktien zuzugreifen (und somit auch die Verfolgung der Anlagestrategien der Teilfonds), wird beeinträchtigt.

#### *Nomineevereinbarungen für das Halten von Anlagen*

Die von ausländischen Anlegern (darunter dem Teilfonds) über Stock Connect erworbenen SSE-Wertpapiere werden von der HKSCC als „Nominee“ treuhänderisch gehalten. Die Stock Connect-Vorschriften der China Securities Regulatory Commission („CSRC“) sehen ausdrücklich vor, dass Anleger die Rechte und Vorteile der SSE-Wertpapiere genießen, die gemäß den geltenden Gesetzen über Stock Connect erworben wurden. Die Gerichte in der VRC können jedoch erwägen, dass ein Nominee oder eine Verwahrstelle als eingetragener Inhaber von SSE-Wertpapieren die vollständigen Eigentumsrechte daran besitzt und dass, obwohl das Konzept des wirtschaftlichen Eigentümers in den Gesetzen der VRC anerkannt wird, diese SSE-Wertpapiere Bestandteil des Vermögenspools dieses Rechtssubjekts sind, der zur Verteilung an Gläubiger dieses Rechtssubjekts zur Verfügung steht, und/oder dass ein wirtschaftlicher Eigentümer keinerlei Rechte diesbezüglich besitzt. Folglich können die Teilfonds und die Verwahrstelle nicht garantieren, dass das Eigentum bzw. die Eigentumsrechte der Teilfonds an diesen Wertpapieren unter allen Umständen garantiert sind.

Gemäß den Regeln des von HKSCC betriebenen Central Clearing and Settlement Systems für das Clearing von Wertpapieren, die an der SEHK notiert sind oder gehandelt werden, ist HKSCC als Nominee-Inhaber nicht verpflichtet, rechtliche Schritte oder Gerichtsverfahren in der VRC oder andernorts anzustrengen, um im Namen der Anleger Rechte bezüglich der SSE-Wertpapiere geltend zu machen. Auch dann, wenn das Eigentum des Teilfonds letztendlich anerkannt wird, kann sich die Durchsetzung der Rechte des Teilfonds daher schwierig oder langwierig gestalten.

Es sei darauf hingewiesen, dass die Verwahrstelle und die Teilfonds für die von der HKSCC ausgeführten Aufgaben, die als Verwahrungsfunktionen für die über sie gehaltenen Vermögenswerte gelten, nicht in einer rechtsgeschäftlichen Beziehung zur HKSCC stehen und für den Fall, dass die Teilfonds aufgrund der Leistungen oder der Zahlungsunfähigkeit der HKSCC Verluste erleiden, über keinerlei direkte rechtliche Handhabe gegen die HKSCC verfügen.

#### *Risiken im Zusammenhang mit dem rechtlichen und wirtschaftlichen Eigentum*

Wenn Wertpapiere grenzüberschreitend verwahrt werden, bestehen bestimmte Risiken bezüglich des rechtlichen bzw. wirtschaftlichen Eigentums, die mit obligatorischen Anforderungen der lokalen zentralen Wertpapierverwahrstellen, der HKSCC und von ChinaClear verbunden sind. Wie in anderen Schwellenmärkten steht der Gesetzgebungsrahmen erst am Anfang der Entwicklung des Konzepts des rechtlichen/formalen Eigentums und des wirtschaftlichen Eigentums sowie des wirtschaftlichen Eigentums oder der Beteiligung an Wertpapieren.

Im Falle eines Zahlungsausfalls von ChinaClear sind die Verpflichtungen der HKSCC im Rahmen ihrer Marktverträge mit Clearing-Teilnehmern darauf beschränkt, die Clearing-Teilnehmer bei Forderungen zu unterstützen. Die HKSCC wird in gutem Glauben handeln, um die Wiedererlangung der ausstehenden Aktien und Gelder von ChinaClear über die zur Verfügung stehenden rechtlichen Kanäle der Liquidation von ChinaClear anzustreben. In diesem Fall ist es möglich, dass die Teilfonds ihre Verluste oder über die China Hong-Kong Stock Connect-Programme erworbenen Wertpapiere nicht vollständig wiedererlangen, und es können Verzögerungen beim Wiedererlangungsprozess auftreten.

#### *Anlegerentschädigung*

Anlagen der Teilfonds über den Northbound-Handel im Rahmen von Stock Connect werden nicht durch den Investor Compensation Fund von Hongkong abgedeckt. Der Investor Compensation Fund von Hongkong wurde eingerichtet, um Anlegern jeglicher Nationalität, die finanzielle Verluste infolge des Ausfalls eines lizenzierten Vermittlers oder zugelassenen Finanzinstituts in Zusammenhang mit börsengehandelten Produkten in Hongkong erleiden, eine Entschädigung zu zahlen.

Da Ausfallangelegenheiten beim Northbound-Handel über Stock Connect keine Produkte umfassen, die an der SEHK oder Hong Kong Futures Exchange Limited notiert sind oder gehandelt werden, sind sie nicht vom Investor Compensation Fund abgedeckt. Andererseits werden die Northbound-Transaktionen des Teilfonds über Wertpapier-Broker in Hongkong und nicht über VRC-Broker getätigt und sind daher nicht vom China Securities Investor Protection Fund der VRC abgedeckt.

#### *Handelskosten*

Neben der Zahlung von Handels- und Stempelgebühren können die Teilfonds neuen Portfoliogeühren, Dividendensteuern und Steuern auf Erträge aus der Übertragung von Aktien unterliegen, die von den relevanten Behörden noch festzulegen sind.

#### *Aufsichtsrisiko*

Bei den Stock Connect-Vorschriften der CSRC handelt es sich um ressortspezifische Vorschriften mit rechtsverbindlicher Wirkung in der VRC. Die Anwendung dieser Vorschriften ist jedoch noch nicht erprobt und es gibt keine Garantie dafür, dass Gerichte in der VRC diese Vorschriften anerkennen, z. B. bei Liquidationsverfahren von VRC-Unternehmen. Das Stock Connect-Programm ist neu und unterliegt den Vorschriften, die von den aufsichtsrechtlichen Behörden erlassen wurden, sowie den Durchführungsbestimmungen der Börsen in der VRC und in Hongkong. Weiterhin können die Regulierungsbehörden von Zeit zu Zeit neue Vorschriften in Bezug auf die Geschäftstätigkeit und die grenzüberschreitende gerichtliche Durchsetzung im Zusammenhang mit grenzüberschreitenden Geschäften im Rahmen von Stock Connect erlassen. Die Vorschriften sind bisher unerprobt und es ist nicht sicher, wie sie angewandt werden. Zudem unterliegen die aktuellen Vorschriften Änderungen. Es kann nicht garantiert werden, dass Stock Connect nicht abgeschafft wird. Die Teilfonds, die über Stock Connect in die VRC-Märkte investieren können, können von derartigen Veränderungen negativ beeinträchtigt werden.

#### *Kontrolle der Währungsumrechnung und der zukünftigen Wechselkursentwicklungen durch die chinesische Regierung*

Seit 1994 basiert die Umrechnung des Onshore-Renminbi CNY in andere Währungen auf den Kursen der People's Bank of China, die täglich auf dem Interbanken-Devisenmarktkurs der VRC des Vortages basieren. Am 21. Juli 2005 hat die Regierung der VRC ein System des gelenkten freien Wechselkurses eingeführt, um die Schwankung des Werts des CNY innerhalb einer festgelegten Bandbreite, die auf Angebot und Nachfrage basiert und sich an einem Währungskorb orientiert, zu ermöglichen. Es kann nicht garantiert werden, dass der Wechselkurs des CNY in Zukunft gegenüber Fremdwährungen nicht stark schwankt.

#### *Risiko in Verbindung mit Unterschieden zwischen Onshore- und Offshore-Renminbi*

Zwar handelt es sich beim Onshore-Renminbi („CNY“) und Offshore-Renminbi („CNH“) um die gleiche Währung, doch werden sie an unterschiedlichen und getrennten Märkten gehandelt. CNY und CNH werden zu unterschiedlichen Kursen gehandelt und entwickeln sich möglicherweise unterschiedlich. Der Renminbi wird immer häufiger „offshore“ (d. h. außerhalb der VRC) gehalten, jedoch kann der CNH

nicht frei in die oder aus der VRC transferiert werden und unterliegt bestimmten Beschränkungen. Anleger sollten beachten, dass Zeichnungen und Rücknahmen in USD erfolgen und in/von CNH umgerechnet werden, und die Anleger tragen die mit dieser Umrechnung verbundenen Devisengebühren und das Risiko einer möglichen Differenz zwischen dem CNY- und dem CNH-Kurs. Die Liquidität und der Handelspreis des Teilfonds können auch durch den Kurs und die Liquidität des Renminbi außerhalb der VRC beeinträchtigt werden.

#### *Risiken in Zusammenhang mit beschränkten Märkten*

Die Teilfonds können in Wertpapieren anlegen, für die die VRC Beschränkungen in Bezug auf ausländische Beteiligungen auferlegt. Solche rechtlichen und aufsichtsrechtlichen Beschränkungen können sich negativ auf die Liquidität und die Wertentwicklung der Bestände der Teilfonds im Vergleich zur Wertentwicklung des Referenzindex auswirken. Dadurch steigt unter Umständen das Risiko in Bezug auf den Tracking Error, und im ungünstigsten Fall können die Teilfonds ihr Anlageziel nicht erreichen und/oder sind erhöhten Liquiditätsrisiken ausgesetzt.

#### *Aussetzungsrisiko*

Der Kauf oder Verkauf von Aktien durch bzw. an die Teilfonds ist nur dann möglich, wenn dieser Kauf bzw. Verkauf an der Shanghai Stock Exchange oder der Shenzhen Stock Exchange durchgeführt werden kann. Angesichts der Tatsache, dass diese Märkte als volatil und instabil gelten (mit dem Risiko der Aussetzung eines bestimmten Wertpapiers oder einer staatlichen Intervention), kann auch die Zeichnung bzw. Rücknahme von Aktien unterbrochen werden.

#### *Betriebs- und Abwicklungsrisiko*

Die Abwicklungsverfahren in der VRC sind weniger entwickelt und können sich von denen in Ländern mit besser entwickelten Finanzmärkten unterscheiden. Die Teilfonds können einem erheblichen Verlustrisiko ausgesetzt sein, wenn ein ernannter Vertreter (z. B. ein Broker oder eine Abwicklungsstelle) seine Aufgaben nicht erfüllt. Die Teilfonds können erhebliche Verluste erleiden, wenn ihre Gegenpartei die von den Teilfonds gelieferten Wertpapiere nicht bezahlt oder aus irgendeinem Grund ihre vertraglichen Verpflichtungen gegenüber dem Teilfonds nicht erfüllt. Andererseits können in bestimmten Märkten erhebliche Verzögerungen bei der Registrierung der Übertragung von Wertpapieren auftreten. Solche Verzögerungen können zu erheblichen Verlusten für den Teilfonds führen, wenn Anlagemöglichkeiten verpasst werden oder wenn der Teilfonds dadurch nicht in der Lage ist, ein Wertpapier zu erwerben oder zu veräußern. Infolgedessen muss zur Begrenzung des Gegenparteirisikos das Broker-Modell mit dem Prinzip „Lieferung gegen Zahlung“ gewählt werden.

#### *Änderungen des Besteuerungsrisikos in der VRC*

Die Regierung der Volksrepublik China hat in den letzten Jahren mehrere Steuerreformmaßnahmen implementiert. Die aktuellen Steuergesetze und -vorschriften können in Zukunft geändert oder ergänzt werden. Jede Änderung oder Ergänzung der Steuergesetze und -vorschriften kann sich auf den Gewinn nach Steuern von chinesischen Unternehmen und ausländischen Anlegern in diesen Unternehmen auswirken. Änderungen der Steuervorschriften können die Erträge nach Steuern jener Anlagen schmälern, an die die Wertentwicklung der Teilfonds gekoppelt ist.

#### *Risiko staatlicher Eingriffe und Beschränkungen*

Regierungen und Regulierungsbehörden können an den Finanzmärkten eingreifen, beispielsweise durch die Einführung von Handelsbeschränkungen für bestimmte Aktien. Dies kann sich auf die Geschäftstätigkeit und das Market Making der Teilfonds auswirken und unvorhersehbare Auswirkungen auf die Teilfonds haben.

Darüber hinaus können sich solche Markteingriffe negativ auf die Marktstimmung auswirken, was wiederum die Wertentwicklung der Teilfonds beeinträchtigen kann.

#### **Risiken in Verbindung mit Anlagen in Wandelanleihen**

Der Wert von Wandelanleihen unterliegt zahlreichen Faktoren, einschließlich: Zinssätzen, Kreditrisiko des Emittenten, zugrunde liegender Aktienkurs und Währung, Emissionswährung und dem Optionspreis, der in den Wandelanleihen enthalten ist. Der Wert kann sich in Abhängigkeit von den wirtschaftlichen Bedingungen und dem Zinssatz, der Bonität des Emittenten, der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktien und allgemeinen Finanzmarktbedingungen erheblich verändern. Darüber hinaus kann es vorkommen, dass der Emittent von Wandelanleihen seinen Zahlungsverpflichtungen nicht nachkommt und sein Kreditrating herabgestuft wird. Wandelanleihen können auch eine geringere Liquidität aufweisen als die zugrunde liegenden Aktienwerte. Ungünstige Veränderungen dieser Faktoren können Teilfonds, die in Wandelanleihen anlegen, negativ beeinflussen.

#### **Risiken in Verbindung mit Anlagen in Contingent Convertible Bonds (CoCos) (Pflichtwandelanleihen)**

Solche Arten von Wandelanleihen, die auch als CoCo-Bonds oder CoCo-Anleihen bekannt sind, werden durch das Bloomberg-Feld „Capital Contingent Security“ referenziert. Sie unterscheiden sich dahingehend geringfügig von den regulären Wandelanleihen, dass die Wahrscheinlichkeit, dass sich die Anleihen in Aktien wandeln von einem bestimmten Ereignis (dem „Trigger“) „bedingt“ abhängig ist, beispielsweise, wenn der Aktienkurs des Unternehmens während eines gewissen Zeitraums ein bestimmtes Niveau überschreitet. Wenn der Trigger eintritt, kann die Anleihe einer Umwandlung in Aktien oder einer Coupon-Streichung unterliegen. Demzufolge können Teilfonds, die in Pflichtwandelanleihen anlegen, einen Verlust erleiden. Darüber hinaus kann es vorkommen, dass diese Anlagen aufgrund ihrer Komplexität falsch bewertet werden.

Sie bergen einen entscheidenden Rechnungslegungsvorteil, da sie im Gegensatz zu anderen Formen von Wandelanleihen nicht in die verwässerten Erträge je Anteil eines Unternehmens aufgenommen werden müssen, bis die Anleihen einen Anspruch auf Umwandlung erreicht haben. Darüber hinaus handelt es sich um eine Form von Kapital, von der die Regulierungsbehörden hoffen, dass es die Finanzen einer Bank in Stresssituationen stützen kann. CoCos unterscheiden sich von den vorhandenen Mischformen (Hybriden), weil sie entwickelt wurden, um in Aktien umgewandelt zu werden, wenn der voreingestellte Trigger durchbrochen wird, um das Kapitalniveau schlagartig zu erhöhen und die Anleger generell zu beruhigen. Diese Mischformen, einschließlich der CoCos, enthalten sowohl Merkmale von Schuldtiteln als auch von Aktien. Sie sollen einen Puffer zwischen vorrangigen Anleihehabern und Aktionären bilden, die zuerst von einem Kapitalverlust betroffen sind. Die Anleihen ermöglichen es einer Bank in der Regel, entweder bis zum ersten Rückzahlungstermin am Kapital festzuhalten, oder die Zahlung von Zinskupons auf die Anleihen auszulassen.

Anleger sollten die Risiken von CoCos in vollem Umfang verstehen und berücksichtigen, und diese Risiken angemessen in ihre Bewertung einbeziehen. Es besteht ein inhärentes Risiko im Zusammenhang mit den Trigger-Schwellen. Diese Schwellen bestimmen das Engagement im Umwandlungsrisiko, je nach Abstand von der Trigger-Schwelle. Der Trigger könnte entweder durch einen wesentlichen Kapitalverlust, wie im Zähler dargestellt, oder durch eine Zunahme von risikogewichteten Vermögenswerten, wie im Nenner bemessen, ausgelöst werden. Dementsprechend kann die Anleihe in einem ungünstigen Moment in Beteiligungspapiere umgewandelt werden. Darüber hinaus besteht das Risiko der Kupon-Streichung. Zwar unterliegen alle CoCos einer Umwandlung oder Abschreibung, wenn die ausgebende Bank die Trigger-Schwelle erreicht hat, doch besteht bei einigen CoCos ein zusätzliches Risiko für den Anleger in Form der Kupon-Streichung in einer Situation der Unternehmensfortführung. Kupon-Zahlungen auf diese Art von Instrumenten sind vollständig diskretionär und können vom Emittenten zu jedem Zeitpunkt, aus jedem Grund und für einen beliebigen Zeitraum gestrichen werden. Die Streichung von Kupon-Zahlungen auf CoCos entspricht nicht einem Ausfallereignis. Gestrichene Zahlungen werden nicht akkumuliert, sondern abgeschrieben. Dadurch erhöht sich die Unsicherheit bei der Bewertung dieser Instrumente erheblich und kann zu einer

Fehlbewertung von Risiken führen. Diesen Inhabern von CoCos können ihre Kupons gestrichen werden, während der Emittent weiterhin Dividenden auf seine Stammaktien und variable Vergütungen an seine Belegschaft zahlt. Im Gegensatz zur klassischen Kapitalhierarchie können CoCo-Anleger auch dann einen Kapitalverlust erleiden, wenn das für die Aktieninhaber nicht der Fall ist. In bestimmten Szenarien werden die Inhaber von CoCo-Bonds vor den Aktieninhabern Verluste erleiden, z.B., wenn ein CoCo-Bond mit hohem Trigger für die erstrangige Abschreibung ausgelöst wird. Dies steht im Widerspruch zu der normalen Reihenfolge der Kapitalstruktur-Hierarchie, im Rahmen derer erwartet wird, dass die Aktieninhaber den ersten Verlust erleiden. Dies ist bei einer CoCo mit niedrigem Trigger weniger wahrscheinlich, wenn die Aktieninhaber bereits einen Verlust erlitten haben werden. Darüber hinaus können CoCos mit hohem Trigger Verluste nicht zum Zeitpunkt eines Insolvenzfalls erleiden, sondern möglicherweise vor CoCos mit niedrigem Trigger und Aktien. Einige CoCos werden als unbefristete Instrumente ausgegeben, die anhand von vorher festgelegten Ebenen ausschließlich mit Zustimmung der zuständigen Behörde abgerufen werden können. Es kann nicht davon ausgegangen werden, dass die unbefristeten CoCos am Abrufdatum abgerufen werden. Diese CoCos sind eine Form von Dauerkapital. In diesen Fällen erhält der Anleger möglicherweise keine Kapitalrückzahlung wie erwartet am Abrufdatum oder an irgendeinem anderen Datum. Darüber hinaus können Risiken aufgrund von „unbekannten Faktoren“ entstehen. In einer gestressten Umgebung, wenn die zugrunde liegenden Merkmale dieser Instrumente einem Test unterzogen werden, ist es ungewiss, wie diese sich entwickeln werden. Für den Fall, dass ein einzelner Emittent einen Trigger aktiviert oder Kupons aussetzt, ist es unklar, ob der Markt diesen Vorfall als idiosynkratisches oder systemisches Ereignis einstufen wird. Im letzteren Fall ist eine mögliche Ansteckungsgefahr in Bezug auf den Preis und die Volatilität der gesamten Vermögensklasse möglich. Dieses Risiko kann wiederum in Abhängigkeit von dem Niveau der zugrunde liegenden Arbitrage zwischen Instrumenten erneut verstärkt werden. Darüber hinaus kann die Preisbildung an einem illiquiden Markt zunehmend Belastungen ausgesetzt sein. Schließlich werden Anleger von diesem Instrument aufgrund der oftmals attraktiven Rendite von CoCos angezogen, die als eine Art Komplexitätsaufschlag angesehen werden kann. Die Rendite war der Hauptgrund dafür, dass diese Anlageklasse eine hohe Nachfrage hervorgerufen hat, doch es bleibt unklar, ob die Anleger die zugrunde liegenden Risiken in vollem Umfang berücksichtigt haben. Im Verhältnis zu höher bewerteten Anleiheemissionen desselben Emittenten oder zu ähnlich bewerteten Anleiheemissionen von anderen Emittenten schneiden CoCos aus Sicht der Rendite vergleichsweise gut ab. Es geht jedoch um die Frage, ob die Anleger das Umwandlungsrisiko oder die Kupon-Streichung in vollem Umfang berücksichtigt haben. Letztendlich sollten Anleger das Risiko einer zunehmenden Branchenkonzentration und das Liquiditätsrisiko in Verbindung mit CoCos gebührend berücksichtigen.

### **Risiken in Verbindung mit Hochzinsanleihen**

Teilfonds, die in Hochzinsanleihen anlegen, sind im Vergleich zu traditionellen Anlageinstrumenten wesentlich höheren Risiken ausgesetzt. Bei der Anlage in einen Teilfonds, der in Hochzinsanleihen investiert, sind Kreditrisiken in Bezug auf die verzinslichen Anlagen möglich.

Schuldtitel mit einem Rating unter Investment-Grade (auch als „Junk Bonds“ bezeichnet), sei es mit oder ohne Rating, sind im Vergleich zu Schuldtiteln mit Investment-Grade-Rating spekulativ, mit größeren Ausfallrisiken behaftet und können stärkeren Kursschwankungen und einem höheren Kreditrisiko unterliegen, da der Emittent möglicherweise nicht in der Lage ist, Zinsen und Kapital bei Fälligkeit zu zahlen, insbesondere in Zeiten schwächerer wirtschaftlicher Bedingungen oder steigender Zinssätze. Herabstufungen des Kreditratings eines einzelnen Emittenten oder verwandter ähnlicher Emittenten, deren Wertpapiere der Fonds in erheblichen Mengen hält, könnten das Engagement des Fonds in Wertpapieren mit einem Rating unter Investment-Grade und den damit verbundenen Risiken, insbesondere dem Liquiditäts- und Ausfallrisiko, in erheblichem und unerwartetem Maß erhöhen. Der Markt für Wertpapiere mit einem Rating unter Investment-Grade kann weniger liquide sein. Daher ist es möglicherweise schwieriger, diese Wertpapiere zu bewerten oder zu einem akzeptablen Preis zu verkaufen, insbesondere in Phasen von Marktvolatilität oder -rückgängen. Da der Fonds in Wertpapieren mit einem Rating unter Investment-Grade investieren kann, weist der Fonds größere Kreditrisiken auf als Fonds, die nur Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating erwerben. Herabstufungen des Kreditratings eines einzelnen Emittenten oder verwandter ähnlicher Emittenten, deren Wertpapiere der Fonds in erheblichen Mengen hält, könnten das Engagement des Fonds in Wertpapieren mit einem Rating unter Investment-Grade und den damit verbundenen Risiken, insbesondere dem Liquiditäts- und Ausfallrisiko, in erheblichem und unerwartetem Maß erhöhen.

### **Risiken in Verbindung mit Anlagen in notleidenden Wertpapieren**

Anlagen in notleidenden Wertpapieren können zusätzliche Risiken für einen Teilfonds verursachen. Solche Wertpapiere werden als überwiegend spekulativ bezeichnet in Bezug auf die Kapazität des Ausgebers, Zinsen und Hauptsumme zu zahlen oder die anderen Bedingungen des angebotenen Produkts über einen langen Zeitraum zu gewährleisten. Sie sind generell ungesichert und könnten anderen ausstehenden Wertpapieren und Gläubigern des Emittenten untergeordnet werden. Auch wenn diese Ausgaben wahrscheinlich eine gewisse Qualität und schützende Eigenschaften haben, wiegen die großen Unsicherheiten und große Risiken auf negative wirtschaftliche Auswirkungen schwerer. Daher kann ein Teilfonds sein gesamtes Vermögen verlieren, Bargeld oder Wertpapiere akzeptieren müssen, die weniger wert sind als die ursprüngliche Investition, bzw. Zahlungen über einen langen Zeitraum akzeptieren müssen. Die Wiedererlangung von Zinsen und Kapital kann weitere Kosten für den betreffenden Teilfonds verursachen. Unter solchen Umständen entschädigen die Renditen aus den Anlagen des Teilfonds die Anteilhaber möglicherweise nicht ausreichend für die übernommenen Risiken.

### **Marktrisiko in Verbindung mit Nachhaltigkeitsrisiken**

Der Marktkurs kann auch durch Risiken in Verbindung mit ESG-Aspekten beeinflusst werden. Zum Beispiel können sich Marktkurse ändern, wenn Unternehmen nicht nachhaltig handeln und nicht in nachhaltige Transformationen investieren. Ebenso können strategische Ausrichtungen von Unternehmen, die Nachhaltigkeitsaspekte nicht berücksichtigen, einen negativen Einfluss auf den Aktienkurs haben. Auch das Reputationsrisiko, das durch nicht nachhaltiges unternehmerisches Handeln entsteht, kann sich negativ auswirken. Daneben können physische Schäden, die durch den Klimawandel oder Maßnahmen zum Übergang zu einer CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaft verursacht werden, den Marktkurs beeinträchtigen.

### **Nachhaltigkeitsrisiko**

ESG-Nachhaltigkeitsrisiko bezeichnet ein Ereignis oder eine Bedingung in den Bereichen Umwelt, Soziales oder Unternehmensführung, dessen beziehungsweise deren Eintreten tatsächlich oder potenziell wesentliche negative Auswirkungen auf den Wert der Investition haben könnte. Nachhaltigkeitsrisiken können entweder selbst ein Risiko darstellen oder andere Risiken nach sich ziehen und Risiken wie Marktrisiken, operationelle Risiken, Liquiditätsrisiken oder Kontrahentenrisiken erheblich erhöhen.

Nachhaltigkeitsrisiken können zu einer erheblichen Verschlechterung des Finanzprofils, der Liquidität, der Rentabilität oder der Reputation der zugrunde liegenden Anlage führen. Sofern das Nachhaltigkeitsrisiko nicht bereits erwartet und in den Bewertungen der Anlagen berücksichtigt wurde, kann es erhebliche negative Auswirkungen auf den erwarteten/geschätzten Marktkurs und/oder die Liquidität der Anlage und damit auf die Rendite der Teilfonds haben.

---

## ANHANG 4 – GEMEINSAME VERWALTUNG

---

Der Verwaltungsrat kann zum Zwecke der Senkung der Betriebs- und Verwaltungskosten bei gleichzeitig breiterer Diversifizierung der Anlagen beschließen, das Vermögen der Teilfonds der Gesellschaft ganz oder teilweise gemeinsam zu verwalten (d. h. ein internes Pooling vorzunehmen). In den nachfolgenden Absätzen bezieht sich der Begriff „gemeinsam verwaltete Vermögenswerte“ sich auf alle Vermögenswerte, die diesen gemeinsam verwalteten Teilfonds gehören, und bei denen es sich aufgrund dieser Vereinbarung zu gemeinsamer Verwaltung um gemeinsam verwaltete Vermögenswerte handelt.

In diesen Fällen werden Vermögenswerte von verschiedenen Teilfonds gemeinsam verwaltet. Gemeinsam verwaltete Vermögenswerte werden als ein „Pool“ bezeichnet, ungeachtet der Tatsache, dass diese Pools ausschließlich für interne Verwaltungszwecke verwendet werden. Diese Pools bilden keine getrennten juristische Personen und sind Anlegern nicht direkt zugänglich. Jeder der gemeinsam verwalteten Teilfonds behält den Anspruch auf seine spezifischen Vermögenswerte und ist für seine Verbindlichkeiten verantwortlich.

Im Rahmen der gemeinsamen Verwaltung kann der Anlageverwalter für die gemeinsam verwalteten Einheiten Entscheidungen über Kauf, Verkauf oder Portfolioumschichtungen treffen, welche die Zusammensetzung der Portfolios ihrer gemeinsam verwalteten Teilfonds beeinflussen. Von allen gemeinsam verwalteten Vermögenswerten gehört jedem gemeinsam verwalteten Teilfonds ein Anteil an den gemeinsam verwalteten Vermögenswerten, der dem Verhältnis seines Nettovermögens zum Gesamtwert der gemeinsam verwalteten Vermögenswerte entspricht. Diese anteilige Beteiligung gilt für alle unter gemeinsamer Verwaltung gehaltenen oder erworbenen Kategorien des Portfolios. Investitions-/Verkaufsentscheidungen haben keine Auswirkungen auf diese Anteile und die zusätzlichen Anlagen werden auf die gemeinsam verwalteten Teilfonds nach den gleichen Anteilen aufgeteilt, und verkaufte Vermögenswerte werden anteilig von den gemeinsam verwalteten Vermögenswerten jedes gemeinsam verwalteten Teilfonds abgezogen.

Im Falle von neuen Zeichnungen von Anteilen eines der gemeinsam verwalteten Teilfonds werden die Zeichnungserlöse den gemeinsam verwalteten Teilfonds entsprechend den veränderten Verhältnissen zugeteilt, die aus der Nettozunahme des Vermögens des gemeinsam verwalteten gezeichneten Teilfonds resultieren, und alle Portfoliokategorien werden durch eine Übertragung von Vermögenswerten von einem gemeinsam verwalteten Teilfonds an den anderen verändert, um sie an die veränderten Verhältnisse anzupassen. In gleicher Weise können im Falle von Rücknahmen von Anteilen eines der gemeinsam verwalteten Teilfonds die erforderlichen Barmittel von den von dem gemeinsam verwalteten Teilfonds gehaltenen Barmitteln entsprechend den veränderten Verhältnissen abgezogen werden, die aus der Abnahme des Nettovermögens des gemeinsam verwalteten Teilfonds resultieren, von dem die Rücknahmen erfolgten, und in diesem Fall werden alle Portfoliopositionen an die veränderten Verhältnisse angepasst. Anleger sollten sich dessen bewusst sein, dass ohne besonderes Eingreifen der zuständigen Organe der Gesellschaft die Technik der gemeinsamen Verwaltung die Zusammensetzung des Vermögens der gemeinsam verwalteten Teilfonds durch Ereignisse beeinflussen kann, welche die anderen gemeinsam verwalteten Teilfonds betreffen, beispielsweise Zeichnungen und Rücknahmen. Unter der Annahme, dass im Übrigen alles unverändert bleibt, führen somit Zeichnungen eines der gemeinsam verwalteten Teilfonds zu einer Erhöhung der flüssigen Mittel des bzw. der anderen gemeinsam verwalteten Teilfonds. Umgekehrt führen Rücknahmen eines der gemeinsam verwalteten Teilfonds zu einer Erhöhung oder Verringerung der flüssigen Mittel des bzw. der anderen gemeinsam verwalteten Teilfonds. Zeichnungen und Rücknahmen können jedoch auf dem spezifischen Konto verbleiben, das für jeden gemeinsam verwalteten Teilfonds außerhalb der Vereinbarung zur gemeinsamen Verwaltung geführt wird und über das Zeichnungen und Rücknahmen normalerweise laufen. Die Zuweisung umfangreicher Zeichnungen und Rücknahmen an dieses spezifische Konto und die für den Verwaltungsrat der Gesellschaft bestehende Möglichkeit, die gemeinsame Verwaltung jederzeit zu beenden, ermöglichen eine Kompensierung der Anpassungen des Portfolios der Teilfonds der Gesellschaft, wenn diese Anpassungen als den Interessen der Teilfonds der Gesellschaft und der Anleger zuwiderlaufend angesehen werden sollten. Falls eine Änderung der Zusammensetzung des Portfolios eines oder mehrerer der gemeinsam verwalteten Teilfonds der Gesellschaft, die aufgrund von Rücknahmen oder Zahlungen von Aufwendungen, welche einem anderen gemeinsam verwalteten Teilfonds zuzurechnen sind, notwendig wird, zu einer Verletzung der anwendbaren Anlagebeschränkungen führen könnte, werden die betreffenden Vermögenswerte vor der Umsetzung der Änderung aus der gemeinsamen Verwaltung herausgenommen, damit sie von den Portfoliobewegungen nicht berührt werden.

Gemeinsam verwaltete Vermögenswerte werden nur mit Vermögenswerten verwaltet, die dazu bestimmt sind, gemäß einem Anlageziel angelegt zu werden, das mit dem der gemeinsam verwalteten Vermögenswerte übereinstimmt, um zu gewährleisten, dass die Anlageentscheidungen in vollem Umfang mit der Anlagepolitik der Teilfonds der Gesellschaft vereinbar sind. Die gemeinsam verwalteten Vermögenswerte werden nur gemeinsam mit Vermögenswerten verwaltet, für welche die Verwahrstelle ebenfalls als Verwahrer fungiert, um zu gewährleisten, dass die Verwahrstelle gegenüber den Teilfonds der Gesellschaft in vollem Umfang ihre Aufgaben und Pflichten nach den Bestimmungen des Gesetzes erfüllen kann.

Die Verwahrstelle gewährleistet jederzeit eine strenge Trennung der Vermögenswerte der gemeinsam verwalteten Teilfonds und ist folglich jederzeit in der Lage, die der Gesellschaft oder den gemeinsam verwalteten Teilfonds gehörenden Vermögenswerte festzustellen.

Von der Gesellschaft, der Verwahrstelle/dem Registerführer und der Verwaltungsgesellschaft wurde und/oder wird eine gemeinsame Verwaltungsvereinbarung unterzeichnet, um die Rechte und Pflichten jeder Partei festzulegen. Der Verwaltungsrat kann jederzeit und ohne vorherige Ankündigung beschließen, die Vereinbarung über gemeinsame Verwaltung zu beenden.

Anleger können sich jederzeit an den eingetragenen Sitz der Gesellschaft wenden, um Informationen zum Prozentsatz der gemeinsam verwalteten Vermögenswerte zu erhalten.

**Liquidation, Zusammenlegung, Übertragung und Teilung von Teilfonds**

Der Verwaltungsrat hat die alleinige Befugnis, im Rahmen der vom Gesetz vorgeschriebenen Bedingungen und Einschränkungen über das Inkrafttreten und die Bedingungen der folgenden Bestimmungen zu entscheiden:

- 1) entweder die einfache Liquidation eines Teilfonds;
- 2) oder die Schließung eines Teilfonds (des zu verschmelzenden Teilfonds) durch Übertragung an einen anderen Teilfonds der Gesellschaft;
- 3) oder die Schließung eines Teilfonds (des zu verschmelzenden Teilfonds) durch Übertragung an einen anderen OGA, gleich ob dieser nach Luxemburger Recht gegründet oder in einem anderen Mitgliedstaat der Europäischen Union errichtet wurde;
- 4) oder die Übertragung an einen Teilfonds (aufnehmender Teilfonds) a) eines anderen Teilfonds der Gesellschaft und/oder b) eines Teilfonds eines anderen Organismus für gemeinsame Anlagen, der nach Luxemburger Recht gegründet oder in einem anderen Mitgliedstaat der Europäischen Union errichtet wurde, und/oder c) eines anderen Organismus für gemeinsame Anlagen, der nach Luxemburger Recht gegründet oder in einem anderen Mitgliedstaat der Europäischen Union errichtet wurde;
- 5) oder die Teilung eines Teilfonds.

Bei der Teilung kommen die gleichen Verfahren zur Anwendung, die vom Gesetz für Zusammenlegungen vorgesehen sind.

Wenn die Gesellschaft aufgrund einer Zusammenlegung nicht fortbesteht, ist in Abweichung zu Vorstehendem für die Wirksamkeit dieser Zusammenlegung ein Beschluss einer Hauptversammlung der Gesellschaft unabhängig vom Anteil des vertretenen Kapitals erforderlich. Die Beschlüsse werden durch einfache Mehrheit der abgegebenen Stimmen gefasst. Die abgegebenen Stimmen enthalten nicht die mit den Anteilen verbundenen Stimmen, für die der Anteilinhaber nicht an der Abstimmung teilgenommen hat, sich enthalten hat oder mit Nein gestimmt hat.

In einem Zeitraum von zwei Monaten vor den oben beschriebenen Maßnahmen kann von der in Teil II beschriebenen Anlagepolitik des betroffenen Teilfonds abgewichen werden.

Im Falle der einfachen Liquidation eines Teilfonds wird dessen Nettovermögen im Verhältnis zur Anzahl der an diesem Teilfonds gehaltenen Anteile auf die anspruchsberechtigten Parteien verteilt. Die Vermögenswerte, die innerhalb von neun Monaten nach einem Liquidationsbeschluss von den Anteilhabern nicht eingefordert worden sind, werden bis zum Ende der gesetzlichen Verjährungsfrist bei der öffentlichen Hinterlegungsstelle (*Caisse de Consignation*) hinterlegt.

Demgemäß kann der auf Ebene eines Teilfonds gefasste Beschluss gleichermaßen auf Ebene einer Kategorie oder Klasse zur Anwendung gelangen.

**Liquidation eines Feeder-Teilfonds**

Ein Feeder-Teilfonds wird liquidiert:

- wenn der Master liquidiert wird, es sei denn, die CSSF genehmigt dem Feeder:
  - mindestens 85 % der Vermögenswerte in Anteile oder Aktien eines anderen Masters anzulegen; oder
  - seine Anlagepolitik so zu ändern, dass er den Status eines Nicht-Feeder-Fonds erlangt.
- wenn der Master mit einem anderen OGAW oder Teilfonds zusammengeführt wird oder in zwei oder mehrere OGAW oder Teilfonds geteilt wird, es sei denn, die CSSF genehmigt dem Feeder:
  - als Feeder desselben Masters oder des aus der Zusammenlegung oder Teilung resultierenden Masters fortzubestehen;
  - mindestens 85 % seiner Vermögenswerte in Anteile oder Aktien eines anderen Masters anzulegen; oder
  - seine Anlagepolitik so zu ändern, dass er den Status eines Nicht-Feeder-Fonds erlangt.

**Auflösung und Liquidation der Gesellschaft**

Der Verwaltungsrat kann jederzeit und aus beliebigem Grund der Hauptversammlung die Auflösung und Liquidation der Gesellschaft vorschlagen. Die Hauptversammlung entscheidet nach demselben Verfahren wie bei Satzungsänderungen.

Wenn das Gesellschaftskapital unter zwei Drittel des gesetzlichen Mindestkapitals fällt, kann der Verwaltungsrat der Hauptversammlung die Frage der Auflösung der Gesellschaft vorlegen. Die Hauptversammlung, für die kein Quorum gilt, beschließt mit einfacher Mehrheit der Stimmen der anwesenden oder vertretenen Anteilinhaber ohne Berücksichtigung von Stimmenthaltungen.

Wenn das Gesellschaftskapital unter ein Viertel des gesetzlichen Mindestkapitals fällt, hat der Verwaltungsrat der Hauptversammlung die Frage der Auflösung der Gesellschaft vorzulegen. Die Hauptversammlung, für die kein Quorum gilt, beschließt mit einem Viertel der Stimmen der anwesenden oder vertretenen Anteilinhaber ohne Berücksichtigung von Stimmenthaltungen.

Eine Liquidation der Gesellschaft erfolgt durch einen oder mehrere Liquidatoren, die natürliche oder juristische Personen sein können. Sie werden von der Hauptversammlung ernannt, die ihre Befugnisse und ihre Vergütung unbeschadet der Anwendung des Gesetzes festlegt.

Der Nettoerlös der Liquidation jedes Teilfonds, jeder Kategorie oder Klasse wird von den Liquidatoren an die Anteilinhaber jedes Teilfonds, jeder Kategorie oder Klasse im Verhältnis zur Anzahl der an diesen Teilfonds, Kategorien oder Klasse gehaltenen Anteile verteilt.

Im Falle der einfachen Liquidation der Gesellschaft wird das Nettovermögen im Verhältnis zur Anzahl der an der Gesellschaft gehaltenen Anteile an die anspruchsberechtigten Parteien ausgeschüttet. Die Vermögenswerte, die innerhalb von höchstens neun Monaten nach dem Liquidationsdatum von den Anteilhabern nicht eingefordert wurden, werden bei der öffentlichen Hinterlegungsstelle (*Caisse de Consignation*) bis zum Ende der gesetzlichen Verjährungsfrist hinterlegt.

Während der Liquidation sind auch die Berechnung des NIW sowie alle Zeichnungen, Umtauschvorgänge und Rücknahmen der Anteile dieser Teilfonds, Kategorien oder Klassen ausgesetzt.

Die Hauptversammlung ist innerhalb von vierzig Tagen nach dem Datum der Feststellung abzuhalten, dass das Nettovermögen der Gesellschaft unter zwei Drittel bzw. ein Viertel des gesetzlichen Minimums gefallen ist.

**TEIL II DES PROSPEKTS**

**SINGLE MANAGER**



# **ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Aegon Global Impact Equities**

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus weltweiten Aktien, deren Unternehmen einen messbaren sozioökonomischen oder umweltbezogenen Nutzen generieren, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

Der Teilfonds verfolgt eine multithematische nachhaltige Anlagestrategie. Der Teilfonds wird sich aus Emittenten zusammensetzen, die sich den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDGs) verpflichtet haben und die SDG Solutions Assessment (SDGA)-Methodik von ISS berücksichtigen. Im Rahmen seines nachhaltigen Investitionsziels investiert der Teilfonds in Emittenten, die einen positiven Beitrag zu ökologischen und sozialen Lösungen leisten.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und kombiniert sowohl quantitative als auch qualitative Finanzmodelle und Folgenabschätzungen. Es werden Anlagen in Unternehmen getätigt, deren Wachstum von langfristigen, nachhaltigen Themen getragen wird und die die Absicht haben, neben finanziellen Erträgen auch zu messbaren positiven sozialen, wirtschaftlichen und ökologischen Effekten beizutragen.

Die Auswirkungen lassen sich anhand der vermiedenen CO<sub>2</sub>-Emissionen, der erzeugten erneuerbaren Energien (in MW), der Anzahl der geschaffenen Arbeitsplätze und der Anzahl der Menschen, die Zugang zu Bildung erhalten haben, messen. Nach Ansicht des Anlageverwalters werden diese Unternehmen aufgrund ihrer Ausrichtung auf die Themen, ihres exzellenten Managements und ihrer soliden Fundamentaldaten starke Wachstumsaussichten aufweisen. Das Ergebnis ist darüber hinaus ein Portfolio aus qualitativ hochwertigen Unternehmen mit 40 bis 80 angemessen bewerteten Positionen, wobei diese Spanne je nach den Marktbedingungen schwanken kann.

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von weltweit ansässigen Unternehmen ausgegeben werden, oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in Schwellenmärkte investieren, einschließlich chinesischer Aktien (A-Aktien).

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor erfüllen und in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds kann auch bis zu 10 % seines Nettovermögens in Schuldtitel (wie fest und variabel verzinsliche Anleihen, Geldmarktinstrumente einschließlich Hochzinsanleihen) investieren, insbesondere zum Zwecke der Barmittelverwaltung.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden, und Geldmarktinstrumenten.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds trägt damit zu ökologischen und sozialen Zielen bei und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

Jedes Wertpapier im Portfolio muss durch das Nachhaltigkeitsresearch abgedeckt sein. Barmittel werden von der ESG-Analyse nicht abgedeckt.

Es wird erwartet, dass die sich daraus ergebenden ESG-Eigenschaften des Teilfonds über dem Referenzportfolio liegen werden und das anfängliche Anlageuniversum nach der Umsetzung der Nachhaltigkeitskriterien um mindestens 20 % reduziert wird. Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 9 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures),
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

## **ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities**

### **Kurzbezeichnung ABN AMRO Aegon Global Impact Equities**

#### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

#### **Anlageverwalter**

ABN AMRO Investment Solutions

#### **Externer Berater**

ABN AMRO Bank N.V.

#### **Dedizierte Vertriebsstelle**

Der Teilfonds wurde auf Initiative von Aegon Investment Management B.V. aufgelegt, einer Gesellschaft mit beschränkter Haftung nach niederländischem Recht mit eingetragenem Sitz in den Niederlanden, Aegonplein 50, 2591 TV Den Haag. Der Teilfonds wird ausschließlich von der Verwaltungsgesellschaft und von Aegon Investment Management B.V. über ihr eigenes Vertriebsnetz vertrieben. Aegon Investment Management B.V. ist nicht an der Anlageverwaltung beteiligt und erbringt keine Beratungsleistungen, stellt dem Anlageverwalter jedoch Berichte über das ESG-Engagement zur Verfügung. Der Engagement-Bericht enthält die wichtigsten Maßnahmen, die Aegon Investment Management B.V. gemeinsam mit den Portfoliounternehmen zur Verbesserung der ESG-Praktiken ergriffen hat. Die Vertriebsgebühren sind Teil der Verwaltungsgebühren. Es werden keine zusätzlichen Gebühren auf Teilfondsebene erhoben.

#### **Risikoprofil**

##### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Betriebs- und Verwahrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

#### **Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

**ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Aegon Global Impact Equities**

**Anteilkategorien**

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU2386528470	Ja	Nein	Alle	100 EUR
	AUS	LU2386528553				
Klasse A3	THES	LU2386528637	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Aegon oder verbundenen Unternehmen und zulässige Anleger sind	100 EUR
	AUS	LU2386528801				
Klasse A4	THES	LU2386528983	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Aegon sind und die Anteilsklasse für Beratungs- und DPM-Aktivitäten und zugelassene Anleger verwenden	100 EUR
	AUS	LU2386529015				
Klasse R	THES	LU2386529106	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR
Klasse C	THES	LU2386529288	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse D	THES	LU2386529361	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU2386529445	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neufilze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse G	THES	LU2445654333	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe mit einer spezifischen Gebührenvereinbarung und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU2445654416	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR
Klasse X	THES	LU2386529528	Ja	Nein	Institutionelle Anleger und OGA	20.000.000 EUR
	AUS	LU2386529791				

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

**Gebühren und Kosten**

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,30 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse A3	0,75 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse A4	0,55 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse R	0,75 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,75 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,75 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,75 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse G	1,30 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse I	0,65 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse X	0,40 %	-	-	0,15 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

## ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities Kurzbezeichnung ABN AMRO Aegon Global Impact Equities

Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse A3	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse A4	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse R	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse G	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-
Klasse X	-	-	-

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

#### **Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

#### **Notierung:**

Keine

#### **Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 5. Juli 2022 aufgelegt.

Keine.

#### **Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen ihrer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

**ABN AMRO Funds Alger US Equities**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Alger US Equities**

# **ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Amundi European ESG Equities**

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus europäischen Aktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in Europa ausgegeben werden, oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen. Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren beträgt 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Anlagen in Schuldtiteln werden 15 % seines Nettovermögens nicht übersteigen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische oder soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Der ESG-Auswahlprozess (Ausschlüsse und ESG-Screenings) wird dazu führen, dass mindestens 20 % des anfänglichen Universums von den Anlagen ausgeschlossen werden, da diese Anlagen nicht qualifiziert sind (Ausschlüsse, erreichte ESG-Ratings).

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds kann zum Zwecke eines höheren Engagements und zur Absicherung in Finanzderivaten anlegen.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Aktienindexfutures, Währungsfutures), zu Anlagezwecken, zur Absicherung und zur effizienten Portfolioverwaltung;
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Externer Anlageverwalter**

Amundi Ireland Limited

### **Risikoprofil**

**Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Betriebs- und Verwaltrisiko
- Schwellenmarktrisiko, Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten
- Risiko von Optionsscheinen

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

## ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities Kurzbezeichnung ABN AMRO Amundi European ESG Equities

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilskategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1577879262	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse C	THES	LU1577879346	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse D	THES	LU1577879429	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1577879692	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neufilze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR

(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

### Gebühren und Kosten

Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,85 %	-	-	0,18 %	0,01 %

(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

EUR in den Kategorien „Klasse A“, „Klasse C“, „Klasse D“ und „Klasse F“.

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

#### **Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

**ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Amundi European ESG Equities**

<b>Zentralisierung der Aufträge</b>	<b>Handelstag der Aufträge</b>	<b>Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW</b>	<b>Abwicklungstag der Aufträge</b>
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*



<p style="text-align: center;"><b>ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities</b> <b>Kurzbezeichnung ABN AMRO Amundi European ESG Equities</b></p>
--

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Dieser Teilfonds wurde am 21. November 2017 mit dem Namen „Asian Equities“ aufgelegt.

Am 1. Februar 2018 änderte der Teilfonds seinen Namen von „Pioneer European Equities“ zu „Amundi European Equities“.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

## **ABN AMRO Funds Aristotle US Equities** **Kurzbezeichnung ABN AMRO Aristotle US Equities**

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus US-Aktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet; dies geschieht durch einen auf Fundamentaldaten ausgerichteten Bottom-Up-Ansatz bei der Titelauswahl, um Unternehmen mit hochwertiger Geschäftstätigkeit zu ermitteln, die attraktiv bewertet sind und geschäftsspezifische Katalysatoren aufweisen. Das Ergebnis ist ein fokussiertes, auf hoher Überzeugung beruhendes Portfolio (in der Regel 30 bis 40 Positionen, wobei diese Spanne je nach den Marktbedingungen schwanken kann), das überwiegend in Large-Cap-Unternehmen investiert ist.

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in Nordamerika ausgegeben werden, oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen. Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Anlagen in Schuldtiteln werden 15 % seines Nettovermögens nicht übersteigen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Im Rahmen des ESG-Ansatzes der Verwaltungsgesellschaft und im Einklang mit den UN PRI schließt der Teilfonds Direktanlagen in Wertpapieren aus, die von Unternehmen ausgegeben werden, die an sehr umstrittenen Aktivitäten beteiligt sind (z. B. der Produktion von Tabak oder umstrittenen Waffen) und/oder schwerwiegend gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen.

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Externer Anlageverwalter**

Aristotle Capital Management, LLC

### **Risikoprofil**

#### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Risiko von Optionsscheinen

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### **Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

**ABN AMRO Funds Aristotle US Equities**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Aristotle US Equities**

**Anteilkategorien**

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU0851647163 „Klasse A-EUR“ LU0849851125 „Klasse A-USD“	Ja	Nein	Alle	100 EUR
	AUS	LU1670605523 „Klasse A-GBP“		Ja		100 USD
Klasse AH EUR	THES	LU1165272862		Nein		100 GBP
Klasse R	THES	LU1670605796, Klasse R-EUR“ LU1670605952 „Klasse R-USD“	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR
	AUS	LU1670605879 „Klasse R-GBP“		Ja		100 USD
Klasse RH EUR	THES	LU1718324202		Nein		100 GBP
Klasse C	THES	LU0849851398	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	100 EUR
Klasse D	THES	LU1406018967	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1329507500	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neufize OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU1308664413 „Klasse I-EUR“ LU0849851471 „Klasse I-USD“	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter und OGA	1.000.000 EUR
						1.000.000 USD
Klasse IH EUR	THES	LU0949827587				1.000.000 EUR
Klasse X1	THES	LU2341654619 „Klasse X1-EUR“ LU2304587079 „Klasse X1-USD“	Ja	Nein	Zugelassene Anleger	50.000.000 EUR
						50.000.000 USD
Klasse X1H	THES	LU2341654700	Ja	Nein	Zugelassene Anleger	50.000.000 EUR
Klasse Z	THES	LU1670606091	Ja	Nein	Zugelassene Anleger	100.000.000 USD

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

**Gebühren und Kosten**

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klassen A, AH EUR	1,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klassen R, RH EUR	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,85 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klassen I, IH EUR	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %
Klasse X1, X1H	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %
Klasse Z	0,00 %	-	-	0,15 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

## ABN AMRO Funds Aristotle US Equities Kurzbezeichnung ABN AMRO Aristotle US Equities

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klassen A, AH EUR	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klassen R, RH EUR	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klassen I, IH EUR	-	-	-
Klasse X1, X1H	-	-	-
Klasse Z	5,00 %	1,00 %	1,00 %

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

### **Zusätzliche Informationen**

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

USD, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

USD in den Kategorien „Klasse A-USD“, „Klasse R-USD“, „Klasse I-USD“, „Klasse X1-USD“ und „Klasse Z“.

EUR in den Kategorien „Klasse A-EUR“, „Klasse AH EUR“, „Klasse R-EUR“, „Klasse RH EUR“, „Klasse C“, „Klasse D“, „Klasse F“, „Klasse I-EUR“, „Klasse IH EUR“ und „Klasse X1- EUR“.

GBP in den Kategorien „Klasse A-GBP“ und „Klasse R-GBP“.

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

#### **Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
13:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

#### **Notierung:**

Keine

#### **Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 4. April 2013 aufgelegt. Die thesaurierende Klasse „Klasse X1-USD“ wurde am 11. März 2021 aufgelegt und die thesaurierende Klasse „Klasse X1-EUR“ wurde am 27. Mai 2021 aufgelegt.

#### **Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

## Kurzbezeichnung Baring Emerging Markets ESG Bonds

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalwachstums mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus nachhaltigen Schwellenmarktanleihen, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Der Teilfonds verwendet eine Auswahl von Wertpapieren, die den Kriterien der ESG-Verantwortung (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung) entsprechen. Das Portfolio setzt sich aus Emittenten zusammen, die entweder eine führende Stellung im Bereich ESG-Praktiken aufweisen oder aufgrund ihrer Fortschritte im Bereich ESG attraktiv sind.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird mittels Top-down- und Bottom-up-Analyse mit starkem Schwerpunkt auf ESG-Analyse verwaltet. Der Schwerpunkt des Top-Down-Ansatzes basiert auf dem Länderrisiko und allgemeinen Markttrends, der Bottom-up-Prozess beruht auf Fundamentaldatenanalyse. Das ESG-Research des externen Anlageverwalters dient dazu, die Emissionen mit dem geringsten ESG-Risiko sowie jene mit den stärksten Verbesserungen hinsichtlich ihres ESG-Risikoprofils auszuwählen.

Der Teilfonds investiert vornehmlich in Schuldtitel von Emittenten (ohne Rating-Beschränkungen) die in Schwellenländern ansässig sind, dort ihren Sitz haben oder dort einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit ausüben.

Zur Erreichung seines Anlageziels kann sich der Teilfonds außerdem einer Vielzahl von (i) Instrumenten bedienen, insbesondere Zinsterminkontrakte, Devisenterminkontrakte (einschließlich nicht lieferbarer Terminkontrakte), Zinsfutures, Anleihenfutures und OTC-Swaps, wie zum Beispiel Zins-Swaps und Credit Default Swaps, und (ii) Strategien, z. B. Antizipation von Zinsbewegungen, Positionierung auf der Zinskurve, Emittentenauswahl, relativer Handel und Währung.

Das Anlageuniversum des Teilfonds umfasst Schuldtitel sowohl in Hartwährung als auch in Lokalwährung.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen durch den Einsatz von Derivaten) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen.

Der Teilfonds wird innerhalb der verbleibenden 40 % seines Gesamtnettovermögens und auf konsolidierter Basis alle folgenden Beschränkungen für Anlagen in den nachfolgenden Wertpapieren/Instrumenten respektieren:

- (i) es dürfen maximal 10 % des Nettovermögens des Teilfonds in übertragbaren Anteilspapieren angelegt werden.
- (ii) es dürfen maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds angelegt werden, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Die Allokation in Aktien ergibt sich aus der Wandlung von Wandelanleihen in Aktien. Der Manager ist nicht befugt, aktiv Aktienwerte zu erwerben.

Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene Vermögenswerte anlegen, doch er darf bis zu 10 % des Nettovermögens des Teilfonds in notleidende Vermögenswerte anlegen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden, und Geldmarktinstrumenten, einschließlich Einlagezertifikaten und kurzfristiger Einlagen.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische oder soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Der ESG-Auswahlprozess (Ausschlüsse und ESG-Screenings) wird dazu führen, dass mindestens 20 % des anfänglichen Universums von den Anlagen ausgeschlossen werden, da diese Anlagen nicht qualifiziert sind (Ausschlüsse, erreichte ESG-Ratings).

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures), zu Anlagezwecken, zur Absicherung und zur effizienten Portfolioverwaltung;
- OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).

Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

## ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds Kurzbezeichnung Baring Emerging Markets ESG Bonds

### Verhältnis zum Referenzportfolio

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Die Berechnungsmethode des Referenzportfolios finden Sie auf der folgenden Website: [www.jpmorgan.com](http://www.jpmorgan.com)

Das bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### Externer Anlageverwalter

Baring Asset Management Limited

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Gegenparteiisiko
- Derivatrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Zinsrisiko
- Wechselkursrisiko
- Risiken von Hochzinsanleihen
- Liquiditätsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

### Anteilskategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU2281289533 „Klasse A-EUR“	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse AH USD		LU2281289616				100 USD
Klasse R	THES	LU2281289889 „Klasse R-EUR“	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse RH USD		LU2281289962				100 USD
Klasse CH USD	THES	LU2281290200	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 USD
	AUS	LU2281290382		Ja		
Klasse C	THES	LU2281290465	Ja	Nein		5.000 EUR
	AUS	LU2281290549		Ja		
Klasse DH USD	THES	LU2281290622	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 USD
Klasse D	AUS	LU2281290895	Ja	Nein		5.000 EUR
Klasse F	THES	LU2281290978	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU2281291190 „Klasse I-EUR“	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter und OGA	1.000.000 EUR
Klasse IH USD		LU2281291273				1.000.000 USD

<sup>(1)</sup> Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

## ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds Kurzbezeichnung Baring Emerging Markets ESG Bonds

### Gebühren und Kosten

Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungs- gebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klassen A, AH USD	1,30 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klassen R, RH USD	0,75 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klassen C, CH USD	0,75 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klassen D, DH USD	0,75 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse F	0,75 %	-	-	0,25 %	0,01 %
Klassen I, IH USD	0,65 %	-	-	0,25 %	0,01 %

(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.

(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr <sup>(2)</sup>	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr <sup>(2)</sup>
Klassen A, AH USD	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klassen R, RH USD	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klassen C, CH USD	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klassen D, DH USD	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klassen I, IH USD	-	-	-

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

USD in den Kategorien „Klasse AH-USD“, „Klasse RH-USD“, „Klasse CH-USD“, „Klasse DH-USD“ und „Klasse I-USD“

EUR in den Kategorien „Klasse A-EUR“, „Klasse R-EUR“, „Klasse C-EUR“, „Klasse D-EUR“, „Klasse F-EUR“ und „Klasse I-EUR“

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

#### **Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

#### **Notierung:**

Keine

#### **Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 9. Dezember 2021 aufgelegt.

#### **Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# **ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Blackrock Euro Government ESG Bonds**

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalwachstums mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus auf Euro lautenden Staatsanleihen, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Der Teilfonds verwendet eine Auswahl von Wertpapieren, die den Kriterien der ESG-Verantwortung (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung, „ESG“) entsprechen. Das Portfolio setzt sich aus Emittenten zusammen, die entweder eine führende Stellung im Bereich ESG-Best-Practice aufweisen oder aufgrund ihrer Fortschritte im Bereich ESG attraktiv sind.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vorwiegend in auf Euro lautende Anleihen und wie Anleihen behandelte Wertpapiere, die von einem der Eurozone angehörenden Mitgliedstaat der Europäischen Union ausgegeben und garantiert werden, wie fest und variabel verzinsliche Anleihen, sowie in Derivate auf diesen Anlagentyp. Es wird hinsichtlich Investitionen in diese Vermögenswerte keine Bewertungsbegrenzung geben. Die Mindestanlage des Teilfonds in solchen Wertpapieren beträgt 60 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Zusätzlich zu den oben aufgeführten Beschränkungen wird der Teilfonds innerhalb der übrigen 40 % seines Gesamtnettovermögens und auf konsolidierter Basis alle folgenden Beschränkungen für Anlagen in den nachfolgenden Wertpapieren/Instrumenten respektieren, die insgesamt ein Drittel seines Gesamtnettovermögens nicht übersteigen dürfen:

(i) es dürfen maximal 25 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in auf Euro lautenden Anleihen angelegt werden, die von Regierungen von Ländern außerhalb der Eurozone ausgegeben werden; (ii) es darf maximal ein Drittel des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Geldmarktinstrumenten angelegt werden; (iii) es dürfen maximal 10 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in anderen OGAW oder OGA angelegt werden.

Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene und/oder notleidende Vermögenswerte investieren.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 90 % des Portfolios ab.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures),
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Externer Anlageverwalter**

BlackRock Investment Management (UK) Ltd

### **Risikoprofil**

**Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Derivatrisiko
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.



# ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Blackrock Euro Government ESG Bonds

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1165273084	Ja	Nein	Alle	100 EUR
	AUS	LU2337050632	Ja	Ja		
Klasse C	THES	LU1165273241	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
	AUS	LU2631872459	Ja	Ja		
Klasse D	THES	LU1670611257	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1329510710	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neufilze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR

<sup>(1)</sup> Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

### Gebühren und Kosten

Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	0,60 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,35 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,35 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,35 %	-	-	0,18 %	0,01 %

<sup>(1)</sup> Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %

<sup>(1)</sup> Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

#### **Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

<p style="text-align: center;"><b>ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds</b> <b>Kurzbezeichnung ABN AMRO Blackrock Euro Government ESG Bonds</b></p>
--

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Dieser Teilfonds wurde am 25. Mai 2016 aufgelegt. Die ausschüttende „Klasse A“ wurde am 25. Juni 2021 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

## Kurzbezeichnung ABN AMRO RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

### Anlageziel

Mittelfristiges Kapitalwachstum mit einem angestrebten Tracking Error von 3 % durch das Hauptengagement am gesamten Euro-Anleihenmarkt und den umfassenden Einsatz von kurzfristigen Zinsderivaten und Anleihenfutures. Der Teilfonds verwendet eine Auswahl von Wertpapieren, die den Kriterien der ESG-Verantwortung (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung, „ESG“) entsprechen. Das Portfolio setzt sich aus Emittenten zusammen, die entweder eine führende Stellung im Bereich ESG-Best-Practice aufweisen oder aufgrund ihrer Fortschritte im Bereich ESG attraktiv sind.

### Anlagepolitik

Die Strategie des Teilfonds basiert auf den Überzeugungen des Anlageverwalters. Dementsprechend investiert er überwiegend in auf Euro lautende Investment-Grade-Unternehmensanleihen von Unternehmen mit Sitz in den Ländern der Eurozone sowie in auf Euro lautende Investment-Grade-Anleihen und Wertpapiere, die Anleihen gleichgestellt sind, die von einem Eurozonen-Mitgliedstaat der Europäischen Union ausgegeben oder garantiert wurden, wie festverzinsliche und variabel verzinsliche Anleihen. Zur Erreichung seines Anlageziels kann sich der Teilfonds außerdem in großem Umfang einer Vielzahl von (i) Instrumenten bedienen, insbesondere Zinsterminkontrakte, Devisenterminkontrakte (einschließlich nicht lieferbarer Terminkontrakte), Zinsfutures, Anleihenfutures und OTC-Swaps, wie zum Beispiel Zins-Swaps und Credit Default Swaps, und (ii) Strategien, z. B. Antizipation von Zinsbewegungen, Positionierung auf der Zinskurve, Emittentenauswahl, relativer Handel und Währung.

Er kann auch ein regelmäßiges Engagement in Schwellenmärkten und Hochzinsanleihen anstreben.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen durch den Einsatz von Derivaten) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen.

Für den Teilfonds gelten die folgenden Beschränkungen:

- Maximales Engagement in festverzinslichen Wertpapieren europäischer Emittenten außerhalb der Eurozone: 20 %
- Maximales Engagement in festverzinslichen Wertpapieren von Emittenten aus Industrieländern außerhalb Europas: 20 %
- Maximales Engagement in Wandelanleihen: 20 %
- Maximales Engagement an High-Yield- und Schwellenmärkten: 30 %
- Maximales Engagement in Geldmarktinstrumenten: 30 %
- Maximales Engagement in nicht bewerteten Wertpapieren: 10 %
- Maximales Engagement in ABS/MBS: 20 %
- Bandbreite der Duration: +/- 2 Jahre (im Vergleich zum Referenzportfolio)
- Maximales Engagement im Währungsrisiko: 10 %
- Maximale Allokation in Aktien: 10 %

Die Allokation in Aktien ergibt sich aus der Wandlung von Wandelanleihen in Aktien. Der Manager ist nicht befugt, aktiv Aktienwerte zu erwerben.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur die Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene Vermögenswerte anlegen, doch er darf bis zu 10 % des Nettovermögens des Teilfonds in notleidende Vermögenswerte anlegen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### Nachhaltige Anlagepolitik

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 90 % des Portfolios ab.

Der ESG-Auswahlprozess (Ausschlüsse und ESG-Screenings) wird dazu führen, dass mindestens 20 % des anfänglichen Universums von den Anlagen ausgeschlossen werden, da diese Anlagen nicht qualifiziert sind (Ausschlüsse, erreichte ESG-Ratings).

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### Derivative Instrumente

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

## **ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds** **Kurzbezeichnung ABN AMRO RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds**

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures), zu Anlagezwecken, zur Absicherung und zur effizienten Portfolioverwaltung;

- OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte). Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

Die voraussichtliche Hebelung des Teilfonds beträgt, basierend auf der Methodik der „Summe der Nominalwerte“, in der Regel nicht mehr als 1.500 % seines Nettoinventarwerts. Wenn Zinskontrakte mit kurzer Laufzeit von der Berechnung ausgeschlossen werden, darf die voraussichtliche Hebelung des Teilfonds in der Regel 300 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds nicht übersteigen. Diese Zinskontrakte mit kurzer Laufzeit umfassen große Positionen und hohe Nominalwerte.

Diese hohe Hebelung ist in erster Linie auf kurzfristige Zinsderivate und auch auf den Einsatz von börsennotierten Anleihenfutures mit kurzer Duration (3 Monate) zurückzuführen, um die Portfolioduration um das Äquivalent von 3 Jahren zu verlängern oder zu verkürzen, während die Gesamtduration des Portfolios wie in Anhang 2 beschrieben, innerhalb der Bandbreite von +/- 2 Jahren im Vergleich zum Referenzportfolio bleibt. Eine solche Derivate-Strategie mit hohem Nominalwert kann eine höhere Hebelung auf der Grundlage der Methodik der „Summe der Nominalwerte“ erzeugen, insbesondere wenn für das Durationsmanagement, wie bei diesem Teilfonds vorgesehen, Instrumente mit kürzerer Duration verwendet werden, während sie das Gesamtrisikoprofil des Teilfonds möglicherweise nicht oder nur geringfügig erhöhen.

Die Hebelung variiert je nach Positionierung des Teilfonds und kann unter bestimmten Umständen (z. B. in einem Marktumfeld, in dem der Teilfonds zur Umsetzung der oben genannten Anlagestrategie sein Vermögen stärker auf Instrumente mit hohem Nominalwert, wie kurzfristige Zinsderivate und Anleihenfutures, verteilt) die oben genannten Grenzen überschreiten, je nach Art und Laufzeit der eingesetzten Instrumente.

Die Methodik der „Summe der Nominalwerte“ gestattet keine Aufrechnung von Deckungsgeschäften oder sonstigen Risikominderungsstrategien unter Verwendung von Derivaten, wie Absicherung von Währungsrisiken, Durationsmanagement und Makroabsicherung. Somit kann die ausgewiesene Hebelung bisweilen die vom Teilfonds angenommene wirtschaftliche Hebelung erheblich übersteigen.

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Externer Anlageverwalter**

RBC Global Asset Management (UK) Limited

### **Risikoprofil**

#### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Kreditrisiko
- Derivatrisiko
- Risiko hoher Hebelung
- Gegenparteirisiko
- Risiken von Hochzinsanleihen
- Liquiditätsrisiko
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### **Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

## ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds Kurzbezeichnung ABN AMRO RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU2054453076	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse C	THES	LU2054453159	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse D	THES	LU2054453233	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU2054453316	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neufilize OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

### Gebühren und Kosten

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	0,70 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,40 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,40 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,40 %	-	-	0,18 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

#### **Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds**

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 4. Juni 2020 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

## Kurzbezeichnung ABN AMRO RBC BlueBay Euro Government Bonds

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalwachstums mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus auf Euro lautenden Staatsanleihen, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Die Strategie des Teilfonds basiert auf den Überzeugungen des Anlageverwalters. Dementsprechend investiert er in auf Euro lautende Investment-Grade-Anleihen und wie Anleihen behandelte Wertpapiere, die von einem der Eurozone angehörenden Mitgliedstaat der Europäischen Union ausgegeben oder garantiert werden, wie fest- und variabel verzinsliche Anleihen, sowie in Derivate auf diesen Anlagentyp. Die Mindestanlage des Teilfonds in solchen Wertpapieren beträgt 60% des Nettovermögens des Teilfonds.

Das Portfolio kann auch in auf Euro und andere Währungen lautende Investment-Grade-Anleihen und wie Anleihen behandelte Wertpapiere investieren, die von einem Staat außerhalb der Eurozone ausgegeben oder garantiert werden, wie fest- und variabel verzinsliche Anleihen, andere fest- und variabel verzinsliche Wertpapiere sowie in Derivate auf diese Art von Vermögenswerten, einschließlich Wertpapieren der Schwellenmärkte und hochverzinslichen Wertpapieren, wenn der Emittent Teil des Referenzportfolios ist.

Für den Teilfonds gelten die folgenden Beschränkungen:

- |   |  |
|---|--|
| - Maximales Engagement in festverzinslichen Wertpapieren mit Investment-Grade-Rating, die von Körperschaften mit Sitz in Ländern außerhalb der Europäischen Union begeben werden, deren langfristige Staatsanleihen ein Investment-Grade-Rating haben | 35 %   |
| - Maximales Engagement in Unternehmensanleihen, garantiert von einem staatlichen Emittenten   | 20 %   |
| - Maximales Engagement in Hochzinsanleihen  | 15 %   |
| - Maximales Engagement in Schwellenmarktanleihen  | 10 %   |
| - Maximales Engagement in Covered Bonds   | 5 %  |
| - Maximales Engagement Währungsrisiko (auf Gesamtebene)   | 5 %  |
| - Duration-Bandbreite   | +/- 2 Jahre (im Vergleich zum Referenzportfolio) |
| - Asiatische Emittenten (einschließlich Russland, Naher Osten und Pazifik)  | verboten   |
| - Allokation in Aktien  | verboten   |

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur die Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene und/oder notleidende Vermögenswerte investieren.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 70 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds darf bis zu 10 % seines Gesamtvermögens in externe passive Fonds und/oder ETF investieren, die Artikel 6 der Offenlegungsverordnung entsprechen. Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8+ geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

# ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

## Kurzbezeichnung ABN AMRO RBC BlueBay Euro Government Bonds

Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II dieses Prospekts zu finden.

### **Derivative Instrumente**

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures),
- OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).

Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

Die voraussichtliche Hebelung des Teilfonds beträgt, basierend auf der Methodik der „Summe der Nominalwerte“, in der Regel nicht mehr als 1.500 % seines Nettoinventarwerts. Wenn Zinskontrakte mit kurzer Laufzeit von der Berechnung ausgeschlossen werden, darf die voraussichtliche Hebelung des Teilfonds in der Regel 300 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds nicht übersteigen. Diese Zinskontrakte mit kurzer Laufzeit umfassen große Positionen und hohe Nominalwerte.

Diese hohe Hebelung ist in erster Linie auf kurzfristige Zinsderivate und auch auf den Einsatz von börsennotierten Anleihenfutures mit kurzer Duration (3 Monate) zurückzuführen, um die Portfolioduration um das Äquivalent von 3 Jahren zu verlängern oder zu verkürzen, während die Gesamtduration des Portfolios wie in Anhang 2 beschrieben, innerhalb der Bandbreite von +/- 2 Jahren im Vergleich zum Referenzportfolio bleibt. Eine solche Derivate-Strategie mit hohem Nominalwert kann eine höhere Hebelung auf der Grundlage der Methodik der „Summe der Nominalwerte“ erzeugen, insbesondere wenn für das Durationsmanagement, wie bei diesem Teilfonds vorgesehen, Instrumente mit kürzerer Duration verwendet werden, während sie das Gesamtrisiko des Teilfonds möglicherweise nicht oder nur geringfügig erhöhen.

Die Hebelung variiert je nach Positionierung des Teilfonds und kann unter bestimmten Umständen (z. B. in einem Marktumfeld, in dem der Teilfonds zur Umsetzung der oben genannten Anlagestrategie sein Vermögen stärker auf Instrumente mit hohem Nominalwert, wie kurzfristige Zinsderivate und Anleihenfutures, verteilt) die oben genannten Grenzen überschreiten, je nach Art und Laufzeit der eingesetzten Instrumente.

Die Methodik der „Summe der Nominalwerte“ gestattet keine Aufrechnung von Deckungsgeschäften oder sonstigen Risikominderungsstrategien unter Verwendung von Derivaten, wie Absicherung von Währungsrisiken, Durationsmanagement und Makroabsicherung. Somit kann die ausgewiesene Hebelung bisweilen die vom Teilfonds angenommene wirtschaftliche Hebelung erheblich übersteigen.

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Externer Anlageverwalter**

RBC Global Asset Management (UK) Limited

### **Risikoprofil**

**Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Derivatrisiko
- Nachhaltigkeitsrisiko
- Risiko hoher Hebelung

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.



## ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds Kurzbezeichnung ABN AMRO RBC BlueBay Euro Government Bonds

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU2757516773	Ja	Nein	Alle	100 EUR
	AUS	LU2757516690	Ja	Ja		
Klasse G	THES	LU2757516427	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe mit einer spezifischen Gebührenvereinbarung und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse R	THES	LU2757518803	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR
Klasse I	THES	LU2757518985	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter und OGA	1.000.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

### Gebühren und Kosten

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	0,60%	-	-	0,18%	0,05%
Klasse G	0,35%	-	-	0,18%	0,01%
Klasse R	0,35%	-	-	0,18%	0,05%
Klasse I	0,30%	-	-	0,18%	0,01%

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist.*

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00%	1,00%	1,00%
Klasse G	5,00%	1,00%	1,00%
Klasse R	5,00%	1,00%	1,00%
Klasse I	-	-	-

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50%) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO RBC BlueBay Euro Government Bonds**

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wird zu einem noch durch den Verwaltungsrat festzulegenden Datum aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# **ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Boston Common US Sustainable Equities**

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus nachhaltigen US-Aktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Der Teilfonds verwendet eine Kombination aus finanziellen und nicht-finanziellen Indikatoren, um Wertpapiere zu identifizieren, die die vom externen Anlageverwalter angewendeten allgemeinen Nachhaltigkeitskriterien erfüllen.

Der Teilfonds wird sich aus Unternehmen zusammensetzen, die in drei langfristigen, nachhaltigen Themenbereichen engagiert sind, darunter (i) „Klimawandel und Erneuerung der Erde“, (ii) „Inklusion und Teilhabe“ und (iii) „Gesundheit und gesellschaftliches Wohlergehen“, und dabei gleichzeitig langfristigen Kapitalzuwachs bieten. Das nachhaltige Anlageziel des Teilfonds soll sich am Pariser Übereinkommen ausrichten, in dem sich die Regierungen der Welt verpflichtet haben, den globalen Temperaturanstieg auf 2 °C über dem vorindustriellen Niveau zu begrenzen. Darüber hinaus investiert der Teilfonds im Rahmen seines sozialen nachhaltigen Investitionsziels in Unternehmen, die einen positiven Beitrag zu sozialen Lösungen leisten.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in Nordamerika ausgegeben werden, oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen durch den Einsatz von Derivaten) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds kann bis zu 10 % in ADR/GDR investieren.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor erfüllen und in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds kann auch bis zu 10 % seines Nettovermögens in Schuldtitel (wie fest und variabel verzinsliche Anleihen, Geldmarktinstrumente einschließlich Hochzinsanleihen) investieren, insbesondere zum Zwecke der Barmittelverwaltung.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds trägt zu ökologischen und sozialen Zielen bei und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

Die nicht-finanzielle Analyse deckt 100 % des Portfolios ab (Barmittel werden nicht in die ESG-Analyse einbezogen).

Der ESG-Auswahlprozess (Ausschlüsse und ESG-Screenings) wird dazu führen, dass mindestens 20 % des anfänglichen Universums von den Anlagen ausgeschlossen werden, da diese Anlagen nicht qualifiziert sind (Ausschlüsse, erreichte ESG-Ratings).

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 9 geltenden Ausschlussbestimmungen ein. Zudem wird der externe Anlageverwalter nicht in Unternehmen investieren, die ein strategisches Engagement im Nuklearbereich haben. Daneben ist der externe Anlageverwalter bestrebt, Anlagen in Unternehmen, die hauptsächlich in der Gewinnung, Exploration, Förderung, Herstellung oder Raffinerie fossiler Brennstoffe tätig sind, zu vermeiden. Er kann jedoch in Unternehmen investieren, die auf fossilen Brennstoffen basierende Energie in ihrem Betrieb einsetzen oder die fossile Brennstoffe vertreiben. Darüber hinaus werden Unternehmen ausgeschlossen, die mehr als 5 % ihres Umsatzes mit unsicheren oder unerwünschten Produkten/Dienstleistungen erwirtschaften. Unternehmen, die in eklatanter Weise gegen Vorschriften verstoßen, ein Muster von Fahrlässigkeit aufweisen, eine durchweg schlechte ESG-Bilanz haben, wissentlich Zwangs- oder Kinderarbeit einsetzen, unverantwortliches Marketing betreiben oder eine sich verschlechternde Bilanz bei messbarem Verhalten aufweisen, werden ebenfalls nicht aufgenommen. Unternehmen des Versorgungssektors, die Strom erzeugen, mit i. einem Kohleanteil von mehr als 10 %, ii. mit einem Öl- und Gasanteil von mehr als 30 %, iii. mit einem Kernkraftanteil von mehr als 30 %, werden ebenfalls vermieden.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds kann zu Zwecken der Anlage, effizienten Portfolioverwaltung oder Absicherung bis zu 10 % seines Nettovermögens in derivative Instrumente und andere Finanzinstrumente wie im Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben investieren.

## ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

### Kurzbezeichnung ABN AMRO Boston Common US Sustainable Equities

#### Verhältnis zum Referenzportfolio

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

#### Externer Anlageverwalter

Boston Common Asset Management, LLC

#### Risikoprofil

##### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Risiko von Optionsscheinen
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

#### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

#### Anteilskategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU2036697717	Ja	Nein	Alle	100 EUR
		„Klasse A-EUR“ LU2036799398				100 USD
Klasse AH EUR	THES	LU2276928715	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse R	THES	LU2276928558	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR
		„Klasse R-EUR“ LU2276928632				100 USD
Klasse RH EUR	THES	LU2508426785	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR
Klasse C	THES	LU2036801392	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
		„Klasse C-EUR“ LU2199262432				5.000 USD
Klasse D	THES	LU2036801558	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU2036801715	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neufilze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU2276928475	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter und OGA	1.000.000 EUR
		„Klasse I-EUR“ LU2276928392				1.000.000 USD
	AUS	LU2474253494		Ja		1.000.000 USD
Klasse IH	THES	LU2474253221	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter und OGA	1.000.000 EUR
		„Klasse IH-EUR“				

<sup>(1)</sup> Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

# ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Boston Common US Sustainable Equities

### Gebühren und Kosten

Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A, AH EUR	1,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse R	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse RH	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,85 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse I	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %
Klasse IH	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %

<sup>(1)</sup> Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A, AH EUR	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse R	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse RH	5,00 %	5,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-
Klasse IH	-	-	-

<sup>(1)</sup> Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

USD, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

USD in den Kategorien „Klasse A-USD“, „Klasse R-USD“, „Klasse C-USD“, und „Klasse I-USD“. EUR in den Kategorien „Klasse A-EUR“, „Klasse AH EUR“, „Klasse R-EUR“, „Klasse RH-EUR“, „Klasse C-EUR“, „Klasse D“, „Klasse F“, „Klasse I-EUR“ und „Klasse IH-EUR“.

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

#### **Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
13:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

<sup>(1)</sup> Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

#### **Notierung:**

Keine

#### **Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 28. Mai 2020 aufgelegt.

#### **Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Boston Common Emerging Markets ESG Equities

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus Schwellenmarktaktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in Schwellenmärkten ausgegeben werden.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen durch den Einsatz von Derivaten) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds kann auch bis zu 10 % seines Nettovermögens in Schuldtitel (wie fest- und variabel verzinsliche Anleihen, Geldmarktinstrumente einschließlich Hochzinsanleihen) investieren, insbesondere zum Zwecke der Barmittelverwaltung. Der Teilfonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens über Shanghai-Hong Kong Stock Connect und Shenzhen-Hong Kong Stock Connect in chinesische Aktien (A-Aktien) investieren, die auf CNH lauten und an der Hong Kong Stock Exchange notiert sind.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

Alle direkten Portfoliobestände an Unternehmensanleihen und Staatsanleihen werden in der nicht-finanziellen Analyse erfasst.

Der ESG-Auswahlprozess (Ausschlüsse und ESG-Screenings) wird dazu führen, dass mindestens 20 % des anfänglichen Universums von den Anlagen ausgeschlossen werden, da diese Anlagen nicht qualifiziert sind (Ausschlüsse, erreichte ESG-Ratings).

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds kann zu Zwecken der Anlage, effizienten Portfolioverwaltung oder Absicherung bis zu 10 % seines Nettovermögens in derivative Instrumente und andere Finanzinstrumente wie u. a. Indexfutures und FX-Forwards, wie im Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben, investieren.

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Externer Anlageverwalter**

Boston Common Asset Management, LLC

### **Risikoprofil**

#### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Betriebs- und Verwaltrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten

## ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities Kurzbezeichnung ABN AMRO Boston Common Emerging Markets ESG Equities

- Risiko von Optionsscheinen
- Nachhaltigkeitsrisiko
- Spezifische Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in China

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilskategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU2757516344	Ja	Nein	Alle	100 EUR
		„Klasse C-EUR“ LU2757518712				100 USD
		„Klasse A-USD“				
Klasse G	THES	LU2757518639	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe mit einer spezifischen Gebührenvereinbarung und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
		„Klasse G-EUR“ LU2757518555				5.000 USD
		„Klasse G-USD“				
Klasse R	THES	LU2757518472	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR
Klasse I	THES	LU2757518126	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter und OGA	1.000.000 EUR
		„Klasse I-EUR“ LU2757518043				1.000.000 USD
	AUS	LU2757517821		Ja		1.000.000 USD

(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

### Gebühren und Kosten

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	2,00%	-	-	0,25%	0,05%
Klasse G	1,10%	-	-	0,25%	0,01%
Klasse R	1,10%	-	-	0,25%	0,05%
Klasse I	1,00%	-	-	0,20%	0,01%

(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist.

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00%	1,00%	1,00%
Klasse G	5,00%	1,00%	1,00%
Klasse R	5,00%	1,00%	1,00%
Klasse I	-	-	-

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

USD, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Boston Common Emerging Markets ESG Equities**

**Nettoinventarwert (NIW):**

USD in den Kategorien „Klasse A-USD“, „Klasse G-USD“ und „Klasse I-USD“.

EUR in den Kategorien „Klasse A-EUR“, „Klasse R“, „Klasse G-EUR“ und „Klasse I-EUR“.

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+3) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wird zu einem noch durch den Verwaltungsrat festzulegenden Datum aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.



# **ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Boston Trust Walden US ESG Equities**

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus nachhaltigen US-Aktien durch die Auswahl von Gesellschaften, die den ESG-Kriterien (Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) entsprechen, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in Nordamerika ausgegeben werden, oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen.

Der Teilfonds wird durch einen proprietären, auf ESG-Fundamentaldatenresearch basierenden Ansatz verwaltet, der durch einen Engagement-Ansatz ergänzt wird. Er investiert in ein diversifiziertes Aktienportfolio unter Berücksichtigung von ESG-Faktoren. Diese Anlagephilosophie konzentriert sich auf die längerfristigen Aussichten eines Unternehmens und nicht auf kurzfristige Ergebnisse.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen durch den Einsatz von Derivaten) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds kann bis zu 10 % in ADR/GDR investieren.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds kann auch bis zu 10 % seines Nettovermögens in Schuldtitel (wie fest und variabel verzinsliche Anleihen, Geldmarktinstrumente einschließlich Hochzinsanleihen) investieren, insbesondere zum Zwecke der Barmittelverwaltung.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

Die Nachhaltigkeitsanalyse deckt 100 % der Wertpapiere im Portfolio ab (Barmittel, Einlagen werden nicht in die ESG-Analyse einbezogen). Nach der Anwendung der Nachhaltigkeitsfilter (Ausschlüsse und ESG-Scoring) werden mehr als 20 % des ursprünglichen Universums entfernt.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds kann zu Zwecken der Anlage, effizienten Portfolioverwaltung oder Absicherung bis zu 10 % seines Nettovermögens in derivative Instrumente und andere Finanzinstrumente wie im Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben investieren.

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Die Berechnungsmethode des Referenzportfolios finden Sie auf der folgenden Website: [www.msci.com](http://www.msci.com).

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Externer Anlageverwalter**

Boston Trust Walden Inc.

## ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities Kurzbezeichnung ABN AMRO Boston Trust Walden US ESG Equities

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Risiko von Optionsscheinen
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilskategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU2281294533 „Klasse A-EUR“ LU2281294616 „Klasse A-USD“	Ja	Nein	Alle	100 EUR
	AUS	LU2281294707 „Klasse A-GBP“		Ja		100 USD
Klasse AH EUR	THES	LU2281294889		Nein		100 GBP
Klasse R	THES	LU2281294962 „Klasse R-EUR“ LU2281295001 „Klasse R-USD“	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR
	AUS	LU2281295183 „Klasse R-GBP“		Ja		100 USD
Klasse RH EUR	THES	LU2281295423		Nein		100 GBP
Klasse C	THES	LU2281295696	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	100 EUR
Klasse D	THES	LU2281295779	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU2281295852	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neufilze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU2281295936 „Klasse I-EUR“ LU2281296074 „Klasse I-USD“	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter und OGA	1.000.000 EUR
	Klasse IH EUR	THES				LU2281296314
Klasse Z	THES	LU2281296405	Ja	Nein	Zugelassene Anleger	1.000.000 EUR
						100.000.000 USD

(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

**ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Boston Trust Walden US ESG Equities**

**Gebühren und Kosten**

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klassen A, AH EUR	1,50%	-	-	0,18%	0,05%
Klassen R, RH EUR	0,85%	-	-	0,18%	0,05%
Klasse C	0,85%	-	-	0,18%	0,05%
Klasse D	0,85%	-	-	0,18%	0,05%
Klasse F	0,85%	-	-	0,18%	0,01%
Klassen I, IH EUR	0,75%	-	-	0,15%	0,01%
Klasse Z	0,00%	-	-	0,15%	0,01%

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist.*

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klassen A, AH EUR	5,00%	1,00%	1,00%
Klassen R, RH EUR	5,00%	1,00%	1,00%
Klasse C	5,00%	1,00%	1,00%
Klasse D	5,00%	1,00%	1,00%
Klasse F	5,00%	1,00%	1,00%
Klassen I, IH EUR	-	-	-
Klasse Z	5,00%	1,00%	1,00%

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

USD, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

USD in den Kategorien „Klasse A-USD“, „Klasse R-USD“, „Klasse I-USD“ und „Klasse Z“.

EUR in den Kategorien „Klasse A-EUR“, „Klasse AH EUR“, „Klasse R-EUR“, „Klasse RH EUR“, „Klasse C“, „Klasse D“, „Klasse F“, „Klasse I-EUR“ und „Klasse IH EUR“.

GBP in den Kategorien „Klasse A-GBP“ und „Klasse R-GBP“.

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
13:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 1. Juli 2023 aufgelegt.

**ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Boston Trust Walden US ESG Equities**

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam Emerging Markets ESG Bonds

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalwachstums mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus nachhaltigen Schwellenmarktanleihen, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Der Teilfonds verwendet eine Auswahl von Wertpapieren, die den Kriterien der ESG-Verantwortung (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung) entsprechen. Das Portfolio setzt sich aus Emittenten zusammen, die entweder eine führende Stellung im Bereich ESG-Best-Practice aufweisen oder aufgrund ihrer Fortschritte im Bereich ESG attraktiv sind.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vornehmlich in Schuldtitel von Emittenten (ohne Rating-Beschränkungen) die in Schwellenländern ansässig sind, dort ihren Sitz haben oder dort einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit ausüben.

Zur Erreichung seines Anlageziels kann sich der Teilfonds außerdem einer Vielzahl von (i) Instrumenten bedienen, insbesondere Zinsterminkontrakte, Devisenterminkontrakte (einschließlich nicht lieferbarer Terminkontrakte), Zinsfutures, Anleihenfutures und OTC-Swaps, wie zum Beispiel Zins-Swaps und Credit Default Swaps, und (ii) Strategien, z. B. Antizipation von Zinsbewegungen, Positionierung auf der Zinskurve, Emittentenauswahl, relativer Handel und Währung.

Das Anlageuniversum des Teilfonds umfasst Schuldtitel sowohl in Lokalwährung als auch in Hartwährung.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen durch den Einsatz von Derivaten) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen.

Der Teilfonds wird innerhalb der verbleibenden 40 % seines Gesamtnettovermögens und auf konsolidierter Basis alle folgenden Beschränkungen für Anlagen in den nachfolgenden Wertpapieren/Instrumenten respektieren:

- (i) es dürfen maximal 25 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Wandelanleihen und sonstigen aktiengebundenen Schuldtiteln angelegt werden;
- (ii) es darf maximal ein Drittel des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Geldmarktinstrumenten, insbesondere Einlagezertifikaten, kurzfristigen Einlagen und Sichteinlagen angelegt werden;
- (iii) es dürfen maximal 10 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in übertragbaren Anteilspapieren angelegt werden;
- (iv) es dürfen maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds angelegt werden, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Die Allokation in Aktien ergibt sich aus der Wandlung von Wandelanleihen in Aktien. Der Manager ist nicht befugt, aktiv Aktienwerte zu erwerben.

Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene Vermögenswerte anlegen, doch er darf bis zu 10 % des Nettovermögens des Teilfonds in notleidende Vermögenswerte anlegen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

Alle direkten Portfoliobestände an Unternehmensanleihen und Staatsanleihen werden in der nicht-finanziellen Analyse erfasst.

Der ESG-Auswahlprozess (Ausschlüsse und ESG-Screenings) wird dazu führen, dass mindestens 20 % des anfänglichen Universums von den Anlagen ausgeschlossen werden, da diese Anlagen nicht qualifiziert sind (Ausschlüsse, erreichte ESG-Ratings).

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures), zu Anlagezwecken, zur Absicherung und zur effizienten Portfolioverwaltung;
- OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).

## ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### Verhältnis zum Referenzportfolio

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Die Berechnungsmethode des Referenzportfolios finden Sie auf der folgenden Website: [www.jpmorgan.com](http://www.jpmorgan.com).

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### Externer Anlageverwalter

Candriam delegiert ihre Portfolioverwaltungsaufgaben an Candriam UK Branch.

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Gegenparteirisiko
- Derivatrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Zinsrisiko
- Wechselkursrisiko
- Risiken von Hochzinsanleihen
- Liquiditätsrisiko
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse AH-USD	THES	LU2041742292	Ja	Nein	Alle	100 USD
Klasse A	THES	LU2041742375				100 EUR
Klasse CH-USD	THES	LU2041742458	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 USD
Klasse C	THES	LU2041742615	Ja	Nein		5.000 EUR
	AUS	LU2041742706		Ja		
Klasse D	AUS	LU2041742961	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU2041743001	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neufilize OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR

(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klassen A, AH USD	1,30 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klassen C, CH USD	0,75 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse D	0,75 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse F	0,75 %	-	-	0,25 %	0,01 %

(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.

(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

**ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam Emerging Markets ESG Bonds**

Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr <sup>(2)</sup>	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr <sup>(2)</sup>
Klassen A, AH USD	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klassen C, CH USD	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

USD in den Kategorien „Klasse AH-USD“ und „Klasse CH-USD“

EUR in den Kategorien „Klasse A“, „Klasse C“, „Klasse D“ und „Klasse F“.

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 25. Februar 2020 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam Euro ESG Short Term Bonds

### **Anlageziel**

Erzielung eines kurzfristigen Kapitalwachstums mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus nachhaltigen kurz laufenden Anleihen, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Der Teilfonds verwendet eine Auswahl von Wertpapieren, die den Kriterien der ESG-Verantwortung (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung) entsprechen. Das Portfolio setzt sich aus Emittenten zusammen, die entweder eine führende Stellung im Bereich ESG-Best-Practice aufweisen oder aufgrund ihrer Fortschritte im Bereich ESG attraktiv sind.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vorwiegend in auf Euro lautende Anleihen und wie Anleihen behandelte Wertpapiere wie fest und variabel verzinsliche Anleihen mit einer durchschnittlichen Restlaufzeit von höchstens 3 Jahren (die Restlaufzeit jeder einzelnen Anlage beträgt höchstens 6 Jahre), sowie in Derivate auf diesen Anlagentyp. Bei variabel verzinslichen Anleihen wird der nächste Zinsanpassungstermin als Fälligkeitsdatum angenommen. Die Mindestanlage des Teilfonds in solchen Wertpapieren beträgt 60 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds wird innerhalb der verbleibenden 40 % seines Gesamtnettovermögens und auf konsolidierter Basis alle folgenden Beschränkungen für Anlagen in den nachfolgenden Wertpapieren/Instrumenten respektieren (basierend auf dem Gesamtnettovermögen des Teilfonds):

- (i) es dürfen maximal 40 % in Geldmarktinstrumenten und Sichteinlagen angelegt werden;
- (ii) es dürfen maximal 10 % in High-Yield-Anleihen angelegt werden;
- (iii) es dürfen maximal 10 % in sonstigen OGAW oder OGA angelegt werden.

Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene Vermögenswerte anlegen, doch er darf bis zu 10 % des Nettovermögens des Teilfonds in notleidende Vermögenswerte anlegen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

Alle direkten Portfoliobestände an Unternehmensanleihen und Staatsanleihen werden in der nicht-finanziellen Analyse erfasst.

Der ESG-Auswahlprozess (Ausschlüsse und ESG-Screenings) wird dazu führen, dass mindestens 20 % des anfänglichen Universums von den Anlagen ausgeschlossen werden, da diese Anlagen nicht qualifiziert sind (Ausschlüsse, erreichte ESG-Ratings).

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures).
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Die Berechnungsmethode des Referenzportfolios finden Sie auf der folgenden Website: [www.euribor-rates.eu](http://www.euribor-rates.eu).

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.



# ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam Euro ESG Short Term Bonds

### Externer Anlageverwalter

Candriam

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Gegenparteiisiko
- Kreditrisiko
- Derivatrisiko
- Zinsrisiko
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1670612651	Ja	Nein	Alle	100 EUR
	AUS	LU2325352701	Ja	Ja		
Klasse R	THES	LU1670612735	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR
Klasse C	THES	LU1670612818	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
	AUS	LU2112790014				
Klasse D	THES	LU1670612909	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1670613030	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neufilze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU1670613113	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	0,40 %	-	-	0,12 %	0,05 %
Klasse R	0,25 %	-	-	0,12 %	0,05 %
Klasse C	0,25 %	-	-	0,12 %	0,05 %
Klasse D	0,25 %	-	-	0,12 %	0,05 %
Klasse F	0,25 %	-	-	0,12 %	0,01 %
Klasse I	0,20 %	-	-	0,12 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

**ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam Euro ESG Short Term Bonds**

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse R	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Notierung:**

Keine

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 3. Dezember 2019 aufgelegt. Die ausschüttende „Klasse A“ wurde am 9. Juli 2021 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# **ABN AMRO Funds Candriam European ESG Convertibles**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam European ESG Convertibles**

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalwachstums mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus nachhaltigen europäischen Wandelanleihen, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error und durch die Auswahl von Wertpapieren, die den Kriterien der ESG-Verantwortung (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung) entsprechen. Das Portfolio setzt sich aus Emittenten zusammen, die entweder eine führende Stellung im Bereich ESG-Best-Practice aufweisen oder aufgrund ihrer Fortschritte im Bereich ESG attraktiv sind.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv auf der Grundlage einer Analyse der Liquidität und einem sich daran anschließenden fundamentaldatenbasierten Top-Down-Ansatz verwaltet, der auf der Einschätzung dreier verschiedener Ausschüsse zu festverzinslichen Anlagen, Vermögensallokation und wirtschaftlichen Gesichtspunkten (d. h. des „Strategic Fixed Income Committee“, des „Asset Allocation Committee“ und des „Economic Outlook Committee“) basiert, die monatlich zusammenkommen.

Das Economic Outlook Committee präsentiert aktuelle Analysen des wirtschaftlichen und finanziellen Umfelds sowie eigene Prognosen, mit besonderem Augenmerk auf Risiken im Zusammenhang mit den verschiedenen Szenarios. Das Strategic Fixed Income Committee entwirft die Festzinsstrategie und die -vermögensallokation für die internen Teams. Das Asset Allocation Committee trifft Entscheidungen bezüglich der optimalen Vermögensallokation. Die einzelnen Ausschüsse setzen sich aus den Leitern der verschiedenen Geschäftsbereiche und dem Chief Information Officer von Candriam zusammen.

Schließlich wird der Portfolioaufbau unter Berücksichtigung des Konzentrationsrisikos nach Emittenten, Sektoren und Regionen sowie mit aktiver Verwaltung des Delta vorgenommen. Der Teilfonds investiert vorwiegend in Wandelanleihen und in auf dem europäischen Markt notierte synthetische Wandelanleihen.

Der Teilfonds kann auch andere Instrumente einsetzen, um sein Anlageziel zu erreichen, wie z. B. Geldmarktinstrumente, Schuldtitel und derivative Instrumente für ein Engagement in Long- und Short-Positionen (wie Forwards, Futures, Optionen, Optionsscheine und Swaps).

Wandelanleihen stellen mindestens ein Engagement von 55 % des Nettovermögens des Teilfonds dar und maximal ein Engagement von 110 % des Nettovermögens des Teilfonds, wobei der Hebel von 10 % durch den Einsatz von Derivaten erzeugt wird.

Der Teilfonds hält auch die folgenden Anlagebeschränkungen ein:

- (i) Maximal 25 % werden in gewöhnlichen Schuldtiteln (Anleihen und einfachen EMTN) angelegt, ausschließlich des Anteils von synthetischen Wandelanleihen, ohne Bewertungsbegrenzung oder spezieller Sensitivität gegenüber Zinssätzen;
- (ii) Maximal 10 % werden in Aktien angelegt;
- (iii) Maximal 10 % werden in französischen oder europäischen OGAW, anderen OGA oder regulierten AIF angelegt.

Der Teilfonds kann anstreben, (i) sein Portfolio auf eine begrenzte Anzahl von Vermögenswerten zu konzentrieren und zugleich die Diversifizierungsbegrenzungen beachten, die vom Gesetz und durch die Richtlinie 2009/65 vorgegeben werden, und (ii) Engagement in Vermögenswerten mit Kreditrisiko (jedoch ausschließlich Investitionen in ausgefallene und/oder notleidende Vermögenswerte) zu erzielen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

Die ESG-Analyse des Verwalters deckt mindestens 90 % der Fondsanlagen ab. Der Anteil von Vermögenswerten „ohne ESG-Rating“ beträgt höchstens 10 % des Nettovermögens.

Der ESG-Auswahlprozess (Ausschlüsse und ESG-Screenings) wird dazu führen, dass mindestens 20 % des anfänglichen Universums von den Anlagen ausgeschlossen werden, da diese Anlagen nicht qualifiziert sind (Ausschlüsse, erreichte ESG-Ratings).

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf schließlich durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

# ABN AMRO Funds Candriam European ESG Convertibles

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam European ESG Convertibles

### Verhältnis zum Referenzportfolio

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### Externer Anlageverwalter

Candriam.

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Risiko von Aktienmärkten
- Derivatrisiko
- Gegenparteiisiko
- Kreditrisiko
- Zinsrisiko
- Risiko des Kapitalverlusts
- Liquiditätsrisiko
- Volatilitätsrisiko
- Wechselkursrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Risiko von Optionsscheinen
- Nachhaltigkeitsrisiko.

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Derivative Instrumente

Um sein Anlageziel zu erreichen, kann der Teilfonds Derivate einsetzen, wie zum Beispiel:

- Aktien- und Aktienindexoptionen;
- Zinsoptionen und Zinsswaps;
- Aktienfutures, Aktienindexfutures, Kreditderivate, Futures auf Staatsanleihen und Zinsfutures;
- Optionsscheine;
- Forwards.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Aufgrund der Tatsache, dass der Teilfonds in ein relativ konzentriertes Portfolio von Vermögenswerten und in Vermögenswerte mit Kreditrisiko investieren kann, werden Anleger darauf hingewiesen, dass die Liquidität und das Kreditrisiko des Teilfonds über dem ähnlicher Wandelanleihen-Fonds liegen kann.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1406018025	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse R	THES	LU1670608899	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR
Klasse F	THES	LU1406018371	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU1406018298	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR
Klasse X	THES	LU1406018454	Ja	Nein	Institutionelle Anleger und OGA	20.000.000 EUR

<sup>(1)</sup> Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

## ABN AMRO Funds Candriam European ESG Convertibles Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam European ESG Convertibles

### Gebühren und Kosten

Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungs- gebühr	Erfolgsgebühr <sup>(2)</sup>	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,40 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse R	0,70 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,70 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse I	0,60 %	-	-	0,15 %	0,01 %
Klasse X	0,50 %	-	-	0,15 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr <sup>(2)</sup>	Umtausch gebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr <sup>(2)</sup>
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse R	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-
Klasse X	-	-	-

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

#### **Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW- Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

#### **Notierung:**

Keine.

#### **Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 3. Dezember 2019 aufgelegt.

#### **Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# **ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam European ESG Smaller Companies Equities**

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalwachstums mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus Aktien kleinerer europäischer Unternehmen, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Der Teilfonds verwendet eine Auswahl von Wertpapieren, die den Kriterien der ESG-Verantwortung (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung) entsprechen. Das Portfolio setzt sich aus Emittenten zusammen, die entweder eine führende Stellung im Bereich ESG-Best-Practice aufweisen oder aufgrund ihrer Fortschritte im Bereich ESG attraktiv sind.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in Europa ausgegeben werden, deren Marktkapitalisierung unter dem Schwellenwert von 15 Milliarden Euro liegt (diese Kapitalisierungszahl kann in Abhängigkeit von den Marktbedingungen von Zeit zu Zeit angepasst werden), oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen. Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt der Mindestbesitz an Aktien in Unternehmen, die in Ländern innerhalb des Europäischen Wirtschaftsraums ansässig sind, welche ein Steuerabkommen mit Frankreich abgeschlossen haben, das eine Klausel über die administrative Zusammenarbeit zur Bekämpfung von Betrug und Steuerflucht enthält, mindestens 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Anlagen in Schuldtiteln werden 15 % seines Nettovermögens nicht übersteigen.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische oder soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die ESG-Analyse des Anlageverwalters deckt mindestens 90 % der Fondsanlagen ab. Der Anteil von Vermögenswerten „ohne ESG-Rating“ beträgt höchstens 10 % des Nettovermögens.

Der ESG-Auswahlprozess (Ausschlüsse und ESG-Screenings) wird dazu führen, dass mindestens 20 % des anfänglichen Universums von den Anlagen ausgeschlossen werden, da diese Anlagen nicht qualifiziert sind (Ausschlüsse, erreichte ESG-Ratings).

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Teilfonds kann auf nicht komplexe Positionen auf derivative Finanzinstrumente oder auf derivative Finanzinstrumente zurückgreifen, die nur zu Absicherungszwecken verwendet werden.

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Die Berechnungsmethode des Referenzportfolios finden Sie auf der folgenden Website: [www.msci.com](http://www.msci.com).

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

# ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam European ESG Smaller Companies Equities

### Externer Anlageverwalter

Candriam

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten
- Betriebs- und Verwahrnisiko
- Risiko von Optionsscheinen

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

### Anteilskategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1890801662	Ja	Ja	Alle	100 EUR
Klasse C	THES	LU2110838757	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse D	THES	LU2110838831	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1890801746	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU1890801829	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR

<sup>(1)</sup> Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,75 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,95 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,95 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,85 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse I	0,75 %	-	-	0,18 %	0,01 %

<sup>(1)</sup> Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

#### Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

<sup>(1)</sup> Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

### Zusätzliche Informationen

#### Rechnungs- und Referenzwährung:

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

<b>ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities</b> <b>Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam European ESG Smaller Companies Equities</b>
--

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 29. November 2019 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.



## **ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities** **Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam European ESG Equities**

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus nachhaltigen europäischen Aktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error und durch die Auswahl von Wertpapieren, die den Kriterien der ESG-Verantwortung (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung) entsprechen. Das Portfolio setzt sich aus Emittenten zusammen, die entweder eine führende Stellung im Bereich ESG-Best-Practice aufweisen oder aufgrund ihrer Fortschritte im Bereich ESG attraktiv sind.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in Europa ausgegeben werden, oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen. Die Auswahl der Anlagen stützt sich auf eine Kombination aus finanziellen Kriterien sowie ESG-Kriterien. Die Mindestvermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt der Mindestbesitz an Aktien in Unternehmen, die in Ländern innerhalb des Europäischen Wirtschaftsraums ansässig sind, welche ein Steuerabkommen mit Frankreich abgeschlossen haben, das eine Klausel über die administrative Zusammenarbeit zur Bekämpfung von Betrug und Steuerflucht enthält, mindestens 75 % des Nettovermögens des Teilfonds. Es dürfen maximal 50 % des Nettovermögens des Teilfonds im Bereich niedriger Börsenkapitalisierungen angelegt werden.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Anlagen in Schuldtiteln werden 15 % seines Nettovermögens nicht übersteigen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

Die ESG-Analyse des Verwalters deckt mindestens 90 % der Fondsanlagen ab. Der Anteil von Vermögenswerten „ohne ESG-Rating“ beträgt höchstens 10 % des Nettovermögens.

Der ESG-Auswahlprozess (Ausschlüsse und ESG-Screenings) wird dazu führen, dass mindestens 20 % des anfänglichen Universums von den Anlagen ausgeschlossen werden, da diese Anlagen nicht qualifiziert sind (Ausschlüsse, erreichte ESG-Ratings).

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Aktienindexfutures, Währungsfutures);
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Die Berechnungsmethode des Referenzportfolios finden Sie auf der folgenden Website: [www.msci.com](http://www.msci.com).

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

## ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam European ESG Equities

### Externer Anlageverwalter

Candriam

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Risiko von Optionsscheinen
- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1481503974	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse R	THES	LU1670606414	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR
Klasse F	THES	LU1481504352	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neufilize OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU1481504196	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR
Klasse X	THES	LU1670606687	Ja	Nein	Institutionelle Anleger und OGA	20.000.000 EUR
Klasse Z	THES	LU1670606505	Ja	Nein	Zugelassene Anleger	100.000.000 EUR
Klasse M	THES	LU1481504279	Ja	Nein	Anleger, die Feeder der Teilfonds der Gesellschaft und zugelassene Anleger sind	20.000.000 EUR

<sup>(1)</sup> Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,75 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse R	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,85 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse I	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %
Klasse X	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %
Klasse Z	0,00 %	-	-	0,15 %	0,01 %
Klasse M	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %

<sup>(1)</sup> Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

**ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam European ESG Equities**

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse R	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-
Klasse X	-	-	-
Klasse Z	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse M	-	-	-

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 29. November 2019 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

## **ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities** **Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam French ESG Equities**

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus französischen Aktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Der Teilfonds verwendet eine Auswahl von Wertpapieren, die den Kriterien der ESG-Verantwortung (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung) entsprechen. Das Portfolio setzt sich aus Emittenten zusammen, die entweder eine führende Stellung im Bereich ESG-Best-Practice aufweisen oder aufgrund ihrer Fortschritte im Bereich ESG attraktiv sind.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in Frankreich ausgegeben werden, oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen. Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt der Mindestbesitz an Aktien in Unternehmen, die in Ländern innerhalb des Europäischen Wirtschaftsraums ansässig sind, welche ein Steuerabkommen mit Frankreich abgeschlossen haben, das eine Klausel über die administrative Zusammenarbeit zur Bekämpfung von Betrug und Steuerflucht enthält, mindestens 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds beachtet außerdem die folgenden Konstruktionsregeln:

- Anlage von maximal 50 % des Nettovermögens des Teilfonds in Aktien mit mittlerer und niedriger Börsenkapitalisierung
- Anlage von maximal 10 % des Nettovermögens des Teilfonds in Aktien von Schwellenländern und internationale Aktien

Anlagen in Schuldtiteln werden 15 % seines Nettovermögens nicht übersteigen.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische oder soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I dargelegt.

Die ESG-Analyse des externen Anlageverwalters deckt mindestens 90 % der Fondsanlagen ab. Der Anteil von Vermögenswerten „ohne ESG-Rating“ beträgt höchstens 10 % des Nettovermögens.

Der ESG-Auswahlprozess (Ausschlüsse und ESG-Screenings) wird dazu führen, dass mindestens 20 % des anfänglichen Universums von den Anlagen ausgeschlossen werden, da diese Anlagen nicht qualifiziert sind (Ausschlüsse, erreichte ESG-Ratings).

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Aktienindexfutures, Währungsfutures);
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Die Berechnungsmethode des Referenzportfolios finden Sie auf der folgenden Website: [www.msci.com](http://www.msci.com).

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

# ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam French ESG Equities

### Externer Anlageverwalter

Candriam

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten
- Risiko von Schwellenmärkten
- Risiko von Optionsscheinen

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

### Anteilskategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1481504436	Ja	Nein	Alle	100 EUR
	AUS	LU1481504519	Ja	Ja		100 EUR
Klasse F	THES	LU1481507025	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neufilze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU1481504600	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR
Klasse M	THES	LU1481504782	Ja	Nein	Anleger, die Feeder der Teilfonds der Gesellschaft und zugelassene Anleger sind	20.000.000 EUR

<sup>(1)</sup> Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,75 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,85 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse I	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %
Klasse M	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %

<sup>(1)</sup> Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

#### Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-
Klasse M	-	-	-

<sup>(1)</sup> Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

### Zusätzliche Informationen

#### Rechnungs- und Referenzwährung:

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### Nettoinventarwert (NIW):

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

<b>ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities</b> <b>Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam French ESG Equities</b>
--

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 18. Dezember 2019 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam Global ESG Convertibles

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalwachstums mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus weltweiten Wandelanleihen, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error und durch die Auswahl von Wertpapieren, die den Kriterien der ESG-Verantwortung (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung) entsprechen. Das Portfolio setzt sich aus Emittenten zusammen, die entweder eine führende Stellung im Bereich ESG-Best-Practice aufweisen oder aufgrund ihrer Fortschritte im Bereich ESG attraktiv sind.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv auf der Grundlage einer Analyse der Liquidität und einem sich daran anschließenden fundamentaldatenbasierten Top-Down-Ansatz verwaltet, der auf der Einschätzung dreier verschiedener Ausschüsse zu festverzinslichen Anlagen, Vermögensallokation und wirtschaftlichen Gesichtspunkten (d. h. des „Strategic Fixed Income Committee“, des „Asset Allocation Committee“ und des „Economic Outlook Committee“) basiert, die monatlich zusammenkommen.

Das Economic Outlook Committee präsentiert aktuelle Analysen des wirtschaftlichen und finanziellen Umfelds sowie eigene Prognosen, mit besonderem Augenmerk auf Risiken im Zusammenhang mit den verschiedenen Szenarios. Das Strategic Fixed Income Committee entwirft die Festzinsstrategie und die -vermögensallokation für die internen Teams. Das Asset Allocation Committee trifft Entscheidungen bezüglich der optimalen Vermögensallokation. Die einzelnen Ausschüsse setzen sich aus den Leitern der verschiedenen Geschäftsbereiche und dem Chief Information Officer von Candriam zusammen.

Schließlich wird der Portfolioaufbau unter Berücksichtigung des Konzentrationsrisikos nach Emittenten, Sektoren und Regionen sowie mit aktiver Verwaltung des Delta vorgenommen.

Der Teilfonds investiert vorwiegend in Wandelanleihen und in auf einem beliebigen Markt notierte synthetische Wandelanleihen.

Der Teilfonds kann auch andere Instrumente einsetzen, um sein Anlageziel zu erreichen, wie z. B. Geldmarktinstrumente, Schuldtitel und derivative Instrumente für ein Engagement in Long- und Short-Positionen (wie Forwards, Futures, Optionen, Optionsscheine und Swaps).

Wandelanleihen stellen mindestens ein Engagement von 55 % des Nettovermögens des Teilfonds dar und maximal ein Engagement von 110 % des Nettovermögens des Teilfonds, wobei der Hebel von 10 % durch den Einsatz von Derivaten erzeugt wird.

Der Teilfonds hält auch die folgenden Anlagebeschränkungen ein:

- (i) Maximal 25 % werden in gewöhnlichen Schuldtiteln (Anleihen und einfachen EMTN) angelegt, ausschließlich des Anteils von synthetischen Wandelanleihen, ohne Bewertungsbegrenzung oder spezieller Sensitivität gegenüber Zinssätzen;
- (ii) Maximal 10 % werden in Aktien angelegt;
- (iii) Maximal 10 % werden in französischen oder europäischen OGAW, anderen OGA oder regulierten AIF angelegt. Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene und/oder notleidende Vermögenswerte investieren.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

Die ESG-Analyse des Verwalters deckt mindestens 90 % der Fondsanlagen ab. Der Anteil von Vermögenswerten „ohne ESG-Rating“ beträgt höchstens 10 % des Nettovermögens.

Der ESG-Auswahlprozess (Ausschlüsse und ESG-Screenings) wird dazu führen, dass mindestens 20 % des anfänglichen Universums von den Anlagen ausgeschlossen werden, da diese Anlagen nicht qualifiziert sind (Ausschlüsse, erreichte ESG-Ratings).

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

### Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam Global ESG Convertibles

#### Verhältnis zum Referenzportfolio

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

#### Externer Anlageverwalter

Candriam

#### Risikoprofil

##### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Risiko von Aktienmärkten
- Derivatrisiko
- Gegenparteiisiko
- Kreditrisiko
- Zinsrisiko
- Risiko des Kapitalverlusts
- Liquiditätsrisiko
- Volatilitätsrisiko
- Wechselkursrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Risiko von Optionsscheinen
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

#### Derivative Instrumente

Um sein Anlageziel zu erreichen, kann der Teilfonds Derivate einsetzen, wie zum Beispiel:

- Aktien- und Aktienindexoptionen;
- Zinsoptionen und Zinsswaps;
- Aktienfutures, Aktienindexfutures, Kreditderivate, Futures auf Staatsanleihen und Zinsfutures;
- Optionsscheine;
- Forwards.

#### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

#### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1406017647	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse R	THES	LU1670609277	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR
Klasse F	THES	LU1406017993	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU1406017720	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR
Klasse X	THES	LU1481505243	Ja	Nein	Institutionelle Anleger und OGA	20.000.000 EUR

(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.



**ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam Global ESG Convertibles**

**Gebühren und Kosten**

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr <sup>(2)</sup>	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,40 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse R	0,70 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,70 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse I	0,60 %	-	-	0,15 %	0,01 %
Klasse X	0,50 %	-	-	0,15 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr <sup>(2)</sup>	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr <sup>(2)</sup>
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse R	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-
Klasse X	-	-	-

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

Zusätzliche Informationen

***Rechnungs- und Referenzwährung:***

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

***Nettoinventarwert (NIW):***

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

***Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:***

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

***Notierung:***

Keine.

***Historische Informationen:***

Der Teilfonds wurde am 18. Dezember 2019 aufgelegt.

***Besteuerung:***

Potenziellen Anteilinhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds Candriam Global Dividend Equities

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam Global Dividend Equities

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalwachstums mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus internationalen Aktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Die Auswahl der Anlagen beruht auf einer Kombination quantitativer und qualitativer Kriterien. Ziel der quantitativen Analyse ist es, Unternehmen mit hohen und stabilen Dividenden zu ermitteln sowie Unternehmen, deren Dividenden in den kommenden Jahren steigen werden. Der Teilfonds wird diese beiden Arten von Unternehmen bevorzugen.

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von Unternehmen weltweit (auch in Schwellenmärkten) und aus allen Wirtschaftssektoren ausgegeben werden, oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen. Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapiere 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Für den Teilfonds gelten die folgenden Beschränkungen:

- Maximales Engagement in Schwellenmärkten: 50 %
- Maximales Engagement in Small Caps und Mid Caps: 50 %

Der Teilfonds geht kein direktes Engagement in Aktien aus Festlandchina ein.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Anlagen in Schuldtiteln betragen höchstens 15 % seines Nettovermögens.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Im Rahmen des ESG-Ansatzes der Verwaltungsgesellschaft und im Einklang mit den UN PRI schließt der Teilfonds Direktanlagen in Wertpapieren aus, die von Unternehmen ausgegeben werden, die an sehr umstrittenen Aktivitäten beteiligt sind (z. B. der Produktion von Tabak oder umstrittenen Waffen) und/oder schwerwiegend gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen.

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds kann auf nicht komplexe Positionen auf derivative Finanzinstrumente oder auf derivative Finanzinstrumente zurückgreifen, die nur zu Absicherungszwecken verwendet werden.

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Aktienindexfutures, Währungsfutures);
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Externer Anlageverwalter**

Candriam

### **Risikoprofil**

**Spezifische Risiken des Teilfonds:**

## ABN AMRO Funds Candriam Global Dividend Equities Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam Global Dividend Equities

- Betriebs- und Verwahrrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, Risiko von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten, Risiko von Optionsscheinen

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1890802801	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse F	THES	LU1890803015	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU1890803288	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

### Gebühren und Kosten

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,75 %	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,85 %	-	0,18 %	0,01 %
Klasse I	0,75 %	-	0,18 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

#### **Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

**ABN AMRO Funds Candriam Global Dividend Equities**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam Global Dividend Equities**

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 3. Dezember 2019 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam Global ESG High Yield Bonds

### Anlageziel

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalwachstums mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus globalen nachhaltigen Hochzinsanleihen, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Der Teilfonds verwendet eine Auswahl von Wertpapieren, die den Kriterien der ESG-Verantwortung (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung) entsprechen. Das Portfolio setzt sich aus Emittenten zusammen, die entweder eine führende Stellung im Bereich ESG-Best-Practice aufweisen oder aufgrund ihrer Fortschritte im Bereich ESG attraktiv sind.

### Anlagepolitik

Der Teilfonds investiert überwiegend und auf diskretionärer Basis in Schuldtitel von High-Yield-Emittenten weltweit.

Zur Erreichung seines Anlageziels kann sich der Teilfonds außerdem einer Vielzahl von (i) Instrumenten bedienen, insbesondere Zinsterminkontrakte, Devisenterminkontrakte (einschließlich nicht lieferbarer Terminkontrakte), Zinsfutures, Anleihenfutures und OTC-Swaps, wie zum Beispiel Zins-Swaps und Credit Default Swaps, und (ii) Strategien, z. B. Antizipation von Zinsbewegungen, Positionierung auf der Zinskurve, Emittentenauswahl, relativer Handel und Währung.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen durch den Einsatz von Derivaten) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen.

Der Teilfonds wird innerhalb der verbleibenden 40 % seines Gesamtnettovermögens und auf konsolidierter Basis alle folgenden Beschränkungen für Anlagen in den nachfolgenden Wertpapieren/Instrumenten respektieren:

- (i) es dürfen maximal 25 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Wandelanleihen und sonstigen aktiengebundenen Schuldtiteln angelegt werden;
- (ii) es darf maximal ein Drittel des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Geldmarktinstrumenten, insbesondere Einlagenzertifikaten, kurzfristigen Einlagen und Sichteinlagen angelegt werden;
- (iii) es dürfen maximal 10 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in übertragbaren Anteilspapieren angelegt werden;

(iv) es dürfen maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds angelegt werden, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Die Allokation in Aktien ergibt sich aus der Wandlung von Wandelanleihen in Aktien. Der Manager ist nicht befugt, aktiv Aktienwerte zu erwerben.

Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene Vermögenswerte anlegen, doch er darf bis zu 10 % des Nettovermögens des Teilfonds in notleidende Vermögenswerte anlegen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### Nachhaltige Anlagepolitik

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

Alle direkten Portfoliobestände an Unternehmensanleihen und Staatsanleihen werden in der nicht-finanziellen Analyse erfasst. Basierend auf dem OECD-Universum werden mindestens 20 % des ursprünglichen Universums im Bereich der Unternehmen und mindestens 20 % im Bereich der staatlichen Emittenten ausgeschlossen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### Derivative Instrumente

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures), zu Anlagezwecken, zur Absicherung und zur effizienten Portfolioverwaltung;
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

### Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam Global ESG High Yield Bonds

#### Verhältnis zum Referenzportfolio

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

#### Externer Anlageverwalter

Candriam

#### Risikoprofil

##### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Gegenparteirisiko
- Derivatrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Zinsrisiko
- Wechselkursrisiko
- Risiken von Hochzinsanleihen
- Liquiditätsrisiko
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

#### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

#### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>	
Klasse AH-USD	THES	LU2041743183	Ja	Nein	Alle	100 USD	
Klasse A	THES	LU2041743266				100 EUR	
Klasse R	THES	LU2254194934	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR	
Klasse CH-USD	THES	LU2041743340	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 USD	
	AUS	LU2041743423		Ja		5.000 EUR	
Klasse C	THES	LU2041743696	Ja	Nein		Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 USD
	AUS	LU2041743779		Ja			5.000 EUR
Klasse DH-USD	THES	LU2041743852	Ja	Nein		5.000 USD	
Klasse D	AUS	LU2041743936	Ja	Nein		5.000 EUR	
Klasse F	THES	LU2041744074	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR	
Klasse I	THES	LU2254194850	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR	

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

### Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam Global ESG High Yield Bonds

#### Gebühren und Kosten

Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klassen A, AH USD	1,30 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse R	0,75 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klassen C, CH USD	0,75 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klassen D, DH USD	0,75 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse F	0,75 %	-	-	0,25 %	0,01 %
Klasse I	0,65 %	-	-	0,20 %	0,01 %

(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.

(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr <sup>(2)</sup>	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr <sup>(2)</sup>
Klassen A, AH USD	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse R	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klassen C, CH USD	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klassen D, DH USD	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

#### Zusätzliche Informationen

##### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

##### **Nettoinventarwert (NIW):**

USD in den Kategorien „Klasse AH-USD“, „Klasse CH-USD“ und „Klasse DH-USD“

EUR in den Kategorien „Klasse A“, „Klasse R“, „Klasse C“, „Klasse D“, „Klasse F“ und „Klasse I“

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

##### **Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

##### **Notierung:**

Keine

##### **Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 14. Mai 2020 aufgelegt.

##### **Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds Candriam Total Return Global Bonds

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam Total Return Global Bonds

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalwachstums mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus internationalen Anleihen, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vornehmlich und diskretionär in Schuldtitel von Emittenten (ohne Rating-Beschränkungen, einschließlich Hochzinsanleihen) aus der ganzen Welt (einschließlich Schwellenmärkten) und aus allen Wirtschaftssektoren. Der Teilfonds kann sich außerdem einer Vielzahl von Instrumenten bedienen (insbesondere Geldmarktinstrumente, Wandelanleihen, Zinsterminkontrakte, Devisenterminkontrakte einschließlich nicht lieferbarer Terminkontrakte, Zinsfutures, Anleihenfutures und OTC-Swaps, wie zum Beispiel Zins-Swaps und Credit Default Swaps). Die Auswahl der Wertpapiere wird durch Strategien bestimmt, insbesondere die Sensitivität in Bezug auf Zinssätze und Kreditspreads.

Die Anlage in Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten kann zwischen 0 und 100 % des Nettovermögens des Teilfonds schwanken.

Für den Teilfonds gelten die folgenden Beschränkungen:

- Maximales Engagement in Wandelanleihen:	20 %
- Maximales Engagement in Hochzins- und Schwellenmarkt-Schuldtiteln:	30 %
- Sensitivität:	0 % bis 7 %
- Maximales Engagement im Währungsrisiko:	10 %
- Maximale Allokation in Aktien:	10 %

Die Allokation in Aktien ergibt sich aus der Wandlung von Wandelanleihen in Aktien. Der Manager ist nicht befugt, aktiv Aktienwerte zu erwerben.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur die Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene Vermögenswerte anlegen, doch er darf bis zu 10 % des Nettovermögens des Teilfonds in notleidende Vermögenswerte anlegen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Im Rahmen des ESG-Ansatzes der Verwaltungsgesellschaft und im Einklang mit den UN PRI schließt der Teilfonds Direktanlagen in Wertpapieren aus, die von Unternehmen ausgegeben werden, die an sehr umstrittenen Aktivitäten beteiligt sind (z. B. der Produktion von Tabak oder umstrittenen Waffen) und/oder schwerwiegend gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen.

### **Derivative Instrumente**

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

-notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures), zu Zwecken der Anlage und der Absicherung;

-OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).

Die Höhe des Engagements durch derivative Finanzinstrumente ist auf 100 % des Nettovermögens des Teilfonds begrenzt. Infolgedessen variiert das Engagement des Teilfonds von 0 bis 200 %.

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Externer Anlageverwalter**

Candriam

### **Risikoprofil**

**Spezifische Risiken des Teilfonds:**



## ABN AMRO Funds Candriam Total Return Global Bonds

### Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam Total Return Global Bonds

- Kreditrisiko
- Derivatrisiko
- Gegenparteirisiko
- Risiken von Hochzinsanleihen
- Risiko von Schwellenmärkten
- Liquiditätsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

#### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

#### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1890809053	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse A Dis	AUS	LU1890809137		Ja		
Klasse R	THES	LU1890809301	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR
Klasse F	THES	LU1890809483	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neufilize OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU1890809566	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

#### Gebühren und Kosten

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,00 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse R	0,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,50 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse I	0,45 %	-	-	0,18 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse R	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

#### Zusätzliche Informationen

##### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

##### **Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

<b>ABN AMRO Funds Candriam Total Return Global Bonds</b> <b>Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam Total Return Global Bonds</b>
--

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 27. November 2020 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# **ABN AMRO Funds Candriam Total Return Global Equities**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam Total Return Global Equities**

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalwachstums mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus internationalen Aktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vornehmlich und diskretionär in Aktien und aktienbezogene Wertpapiere. Dabei bestehen keine Einschränkungen in Bezug auf Länder (einschließlich der Schwellenländer, jedoch ohne Aktien aus Festlandchina), Sektoren oder Währungen.

Der Teilfonds kann außerdem Schuldtitel und Geldmarktinstrumente (ohne Ratingbeschränkungen) von Emittenten aus aller Welt (einschließlich der Schwellenmärkte) und allen Wirtschaftssektoren einsetzen. Die Anlage in Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten kann zwischen 0 und 49 % des Nettovermögens des Teilfonds schwanken.

Der Teilfonds wird aktiv und flexibel verwaltet. Haupttreiber für das Portfoliomanagement ist die Allokation in Aktien (mindestens 51 % des Nettovermögens des Teilfonds). Das Risikoniveau des Portfolios kann daher ebenso hoch steigen wie bei einem reinen Aktienportfolio.

Der Portfoliomanager wählt je nach seinen Erwartungen und Überzeugungen in Bezug auf Risiken und Chancen verschiedene Anlageklassen, geografische Bereiche, Sektoren und Managementstile (Value, gemischt oder Wachstum auf der Aktienseite) aus. Die Festlegung der Allokation erfolgt durch eine Fundamentalanalyse des wirtschaftlichen und finanziellen Umfelds. Der Portfoliomanager legt die Allokation in den verschiedenen Anlageklassen und Anlagearten fest.

Die Allokation kann erheblich von dem Referenzportfolio des Teilfonds abweichen.

Die Allokation in Aktien wird zwischen 51 % und 100 % des Nettovermögens des Teilfonds liegen, wobei keine Einschränkungen in Bezug auf Marktkapitalisierung oder Länder (einschließlich Schwellenländer) bestehen.

Bei der Rentenstrategie wird die Sensitivität der Strategie zwischen -4 % und +10 % liegen.

Der Teilfonds geht kein direktes Engagement in Aktien aus Festlandchina ein.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke der Verwaltungsgesellschaften sowie ihr Anlageprozess und ihre Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur die Anlagefonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Im Rahmen des ESG-Ansatzes der Verwaltungsgesellschaft und im Einklang mit den UN PRI schließt der Teilfonds Direktanlagen in Wertpapieren aus, die von Unternehmen ausgegeben werden, die an sehr umstrittenen Aktivitäten beteiligt sind (z. B. der Produktion von Tabak oder umstrittenen Waffen) und/oder schwerwiegend gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen.

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds kann zu Zwecken des Engagements in derivative Finanzinstrumente investieren.

Der Teilfonds kann zu Absicherungszwecken in derivative Finanzinstrumente investieren. Die Höhe des Engagements für Absicherungszwecke kann bis zu 100 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Der Teilfonds kann zu Währungszwecken in derivative Finanzinstrumente investieren. Die Höhe des Engagements für Währungszwecke kann bis zu 100 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Aktienindexfutures, Währungsfutures),
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

Der Einsatz von Finanzderivaten ist auf 100 % des Nettovermögens des Teilfonds begrenzt.

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

# ABN AMRO Funds Candriam Total Return Global Equities

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam Total Return Global Equities

### Externer Anlageverwalter

Candriam

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Betriebs- und Verwahrrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten
- Kreditrisiko
- Derivatrisiko
- Gegenparteiisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1890809996	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse F	THES	LU1890810143	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU1890810226	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR

(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,75 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,85 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse I	0,75 %	-	-	0,18 %	0,01 %

(1) Ferner kann die Gesellschaft der Besteuerung und/oder Regulierungsabgaben für ausländische OGA in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist.

#### Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

<b>ABN AMRO Funds Candriam Total Return Global Equities</b> <b>Kurzbezeichnung ABN AMRO Candriam Total Return Global Equities</b>
--

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 27. November 2020 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# **ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO EdenTree European Sustainable Equities**

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus nachhaltigen europäischen Aktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Der Teilfonds verwendet eine Kombination aus finanziellen und nicht-finanziellen Indikatoren, um Wertpapiere zu identifizieren, die die vom externen Anlageverwalter angewendeten allgemeinen Nachhaltigkeitskriterien erfüllen. Der Teilfonds wird aus Emittenten bestehen, die in vier langfristigen nachhaltigen Themen engagiert sind, darunter (i) „Bildung“, (ii) „Gesundheit und Wohlbefinden“, (iii) „soziale Infrastruktur“ und (iv) „Nachhaltige Lösungen“.

Das nachhaltige Anlageziel des Teilfonds soll sich am Pariser Übereinkommen ausrichten, in dem sich die Regierungen der Welt verpflichtet haben, den globalen Temperaturanstieg auf weniger als 2 °C über dem vorindustriellen Niveau zu begrenzen. Darüber hinaus investiert der Teilfonds im Rahmen seines sozialen nachhaltigen Investitionsziels in Unternehmen, die einen positiven Beitrag zu sozialen Lösungen leisten.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in Europa ausgegeben werden, oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen. Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren beträgt 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor erfüllen und in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Anlagen in Schuldtiteln werden 15 % seines Nettovermögens nicht übersteigen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Politik**

Der Teilfonds trägt zu ökologischen und sozialen Zielen bei und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

Die ESG-Analyse deckt 100 % des Portfolios ab. Nach Überprüfung des Anlageuniversums werden mindestens 20 % der Unternehmen auf der Grundlage von SRI-Kriterien ausgeschlossen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 9 geltenden Ausschlussbestimmungen ein. Darüber hinaus werden auch ethische Filter für externe Investmentmanager implementiert. Durch die Kombination beider Ausschlüsse werden Marktbereiche, die soziale oder ökologische Schäden verursachen (z. B. Tabak, Waffen, Glücksspiel), auf der Grundlage des Grundsatzes „keinen Schaden verursachen“ ausgeschlossen.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf nur zu Zwecken der effizienten Portfolioverwaltung in derivative Instrumente und andere Finanzinstrumente wie im Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben investieren.

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Die Berechnungsmethode des Referenzportfolios finden Sie auf der folgenden Website: [www.msci.com](http://www.msci.com).

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

# ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

## Kurzbezeichnung ABN AMRO EdenTree European Sustainable Equities

### Externer Anlageverwalter

EdenTree Investment Management Limited.

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Betriebs- und Verwahrrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten
- Risiko von Optionsscheinen
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1481504865	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse R	THES	LU1670606257	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR
Klasse C	THES	LU1481504949	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse D	THES	LU1670606174	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1481505086	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neufilize OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU1670606331	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR
	AUS	LU2474253577		Ja		
Klasse Z	THES	LU1890795674	Ja	Nein	Zugelassene Anleger	100.000.000 EUR

(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse R	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,85 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse I	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %
Klasse Z	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %

(1) Ferner kann die Gesellschaft der Besteuerung und/oder Regulierungsabgaben für ausländische OGA in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist.

**ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO EdenTree European Sustainable Equities**

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse R	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-
Klasse Z	5,00 %	1,00 %	1,00 %

<sup>(1)</sup> Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

<sup>(1)</sup> Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Dieser Teilfonds wurde am 19. Januar 2017 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.



## **ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities** **Kurzbezeichnung ABN AMRO Emerging Markets ESG Equities**

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus Schwellenmarktaktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Um die zulässigen Wertpapiere auszuwählen, führt der Verwalter sowohl eine finanzielle als auch eine nicht-finanzielle Analyse unter Verwendung von ESG-Kriterien (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung) in Kombination mit Ausschlussfiltern durch. Das Portfolio setzt sich aus Emittenten zusammen, die eine führende Stellung im Bereich ESG-Best-Practices aufweisen.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in Schwellenmärkten ausgegeben werden.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen durch den Einsatz von Derivaten) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapiere 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens über Shanghai-Hong Kong und Shenzhen Stock Connect in chinesische Aktien (A-Aktien) investieren, die auf CNH lauten und an der Hong Kong Stock Exchange notiert sind.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds kann auch bis zu 10 % seines Nettovermögens in Schuldtitel (wie fest und variabel verzinsliche Anleihen, Geldmarktinstrumente einschließlich Hochzinsanleihen) investieren, insbesondere zum Zwecke der Barmittelverwaltung.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische oder soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 90 % des Portfolios ab. Der Verwalter verwendet einen selektiven Ansatz, der das Anlageuniversum um mindestens 20 % reduziert.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Teilfonds kann auf nicht komplexe Positionen auf derivative Finanzinstrumente oder auf derivative Finanzinstrumente zurückgreifen, die nur zum Zwecke der Anlage, Absicherung oder effizienten Portfolioverwaltung verwendet werden.

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Referenzportfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

Des Weiteren bewertet oder berücksichtigt das Referenzportfolio seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

### **Anlageverwalter**

ABN AMRO Investment Solutions

### **Risikoprofil**

**Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Betriebs- und Verwahrisiko

## ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities Kurzbezeichnung ABN AMRO Emerging Markets ESG Equities

- Risiko von Schwellenmärkten
- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten
- Spezifische Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in China
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilskategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU2445654507	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse G	THES	LU2445654689	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe mit einer spezifischen Gebührenvereinbarung und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse R	THES	LU2445654762	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR
Klasse I	THES	LU2445654846	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter und OGA	1.000.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

### Gebühren und Kosten

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	2,00 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse G	2,00 %	-	-	0,25 %	0,01 %
Klasse R	1,10 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse I	1,00 %	-	-	0,25 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse G	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse R	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

USD, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

EUR in den Kategorien „Klasse A“, „Klasse G“, „Klasse R“ und „Klasse I“.

**ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Emerging Markets ESG Equities**

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal drei Bankgeschäftstage nach dem Bewertungstag (T+3) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wird zu einem noch durch den Verwaltungsrat festzulegenden Datum aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

## **ABN AMRO Funds Global ESG Equities**

### **Kurzbezeichnung ABN AMRO Global ESG Equities**

#### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus nachhaltigen internationalen Aktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Um die zulässigen Wertpapiere auszuwählen, führt der Verwalter sowohl eine finanzielle als auch eine nicht-finanzielle Analyse unter Verwendung von ESG-Kriterien (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung) in Kombination mit Ausschlussfiltern durch. Das Portfolio setzt sich aus Emittenten zusammen, die eine führende Stellung im Bereich ESG-Best-Practices aufweisen.

#### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von Unternehmen weltweit ausgegeben werden, oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in Schwellenmärkte investieren, einschließlich chinesischer Aktien (A-Aktien).

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Anlagen in Schuldtiteln betragen höchstens 10 % seines Nettovermögens.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

#### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 90 % des Portfolios ab. Der Verwalter verwendet einen selektiven Ansatz, der das Anlageuniversum um mindestens 20 % reduziert.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

#### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Teilfonds kann auf nicht komplexe Positionen auf derivative Finanzinstrumente oder auf derivative Finanzinstrumente zurückgreifen, die nur zu Absicherungszwecken verwendet werden.

#### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Die Berechnungsmethode des Referenzportfolios finden Sie auf der folgenden Website: [www.msci.com](http://www.msci.com).

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

#### **Anlageverwalter**

ABN AMRO Investment Solutions

#### **Externer Berater**

ABN AMRO Bank N.V.

## ABN AMRO Funds Global ESG Equities Kurzbezeichnung ABN AMRO Global ESG Equities

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Betriebs- und Verwaltrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten
- Risiken in Verbindung mit Anlagen in Asien
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilkategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU0756526744	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse C	THES	LU0756527049	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse CH EUR	THES	LU0756527122	Ja	Nein		5.000 EUR
Klasse D	THES	LU1670611174	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse E	THES	LU1029691976	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung von ABN AMRO und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1329507765	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neufilze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse G	THES	LU2445654929	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe mit einer spezifischen Gebührenvereinbarung und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU0851647916	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR

<sup>(1)</sup> Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klassen C, CH EUR	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse E	0,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,85 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse G	1,50 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse I	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %

<sup>(1)</sup> Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

## ABN AMRO Funds Global ESG Equities Kurzbezeichnung ABN AMRO Global ESG Equities

Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klassen C, CH EUR	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse E	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse G	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

#### **Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

#### **Notierung:**

Keine

#### **Historische Informationen:**

Dieser Teilfonds wurde am 25. März 2013 aufgelegt.

#### **Besteuerung:**

Potenziellen Anteilinhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# **ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Impax US ESG Equities**

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus nachhaltigen US-Aktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Die Strategie des Teilfonds zielt darauf ab, in Unternehmen mit Wettbewerbsvorteilen im Bereich Nachhaltigkeit zu investieren, die in der Lage sind, über den Anlagehorizont hohe oder steigende Renditen zu erzielen. Der Teilfonds verwendet eine Kombination aus finanziellen und nicht-finanziellen Indikatoren, um Wertpapiere zu identifizieren, die die vom externen Anlageverwalter angewendeten allgemeinen Nachhaltigkeitskriterien erfüllen.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in den USA ausgegeben werden, oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen durch den Einsatz von Derivaten) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds kann bis zu 10 % in ADR/GDR investieren.

Der Teilfonds kann maximal 10 % seines Nettovermögens in zulässige OGAW anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur zulässige OGAW mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds kann auch bis zu 10 % seines Nettovermögens in Schuldtitel (wie fest und variabel verzinsliche Anleihen, Geldmarktinstrumente einschließlich Hochzinsanleihen) investieren, insbesondere zum Zwecke der Barmittelverwaltung.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Daher hat das Portfolio im Vergleich zu seiner Benchmark eine bessere ESG-Bewertung. Jede Aktie im Portfolio des Teilfonds wird einer ESG-Analyse unterzogen. Mindestens 20 % der Unternehmen des ursprünglichen Anlageuniversums kommen für eine Aufnahme in das Portfolio nicht in Frage.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Aktienindexfutures, Währungsfutures);
- OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).

Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

## ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities Kurzbezeichnung ABN AMRO Impax US ESG Equities

### Externer Anlageverwalter

Impax Asset Management, LLC

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Risiko von Optionsscheinen
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilskategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU2546367207 „Klasse A-EUR“ LU2546367116 „Klasse A-USD“	Ja	Nein	Alle	100 EUR
				Ja		100 USD
	AUS	LU2546367033 „Klasse A-GBP“				100 GBP
Klasse AH EUR	THES	LU2546366902		Nein		100 EUR
Klasse R	THES	LU2546366811 „Klasse R-EUR“ LU2546366738 „Klasse R-USD“	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR
				Ja		100 USD
	AUS	LU2546366571 „Klasse R-GBP“				100 GBP
Klasse RH EUR	THES	LU2546366498		Nein		100 EUR
Klasse C	THES	LU2546366225 „Klasse C-EUR“	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU2546366142 „Klasse I-EUR“ LU2546366068 „Klasse I-USD“	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR
				Ja		1.000.000 USD
	AUS	LU2546368197 „Klasse I-GBP“				1.000.000 GBP
Klasse IH EUR	THES	LU2546368270		Nein		1.000.000 EUR

<sup>(1)</sup> Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klassen A, AH EUR	1,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klassen R, RH EUR	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klassen I, IH EUR	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %

<sup>(1)</sup> Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist



**ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Impax US ESG Equities**

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klassen A, AH EUR	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klassen R, RH EUR	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klassen I, IH EUR	-	-	-

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

USD, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

USD in den Kategorien „Klasse A-USD“, „Klasse R-USD“ und „Klasse I-USD“. EUR in den Kategorien „Klasse A-EUR“, „Klasse AH-EUR“, „Klasse R-EUR“, „Klasse RH-EUR“, „Klasse C“, „Klasse I-EUR“ und „Klasse IH-EUR“.

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
13:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 14. Dezember 2022 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds Insight Euro Aggregate Bonds

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Insight Euro Aggregate Bonds

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus auf Euro lautenden Aggregate Bonds, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Die Strategie des Teilfonds basiert auf einem ausgewogenen Risikoansatz. Dementsprechend investiert er überwiegend in auf Euro lautende Investment-Grade-Unternehmensanleihen von Unternehmen mit Sitz in den Ländern der Eurozone sowie in auf Euro lautende Investment-Grade-Anleihen und Wertpapiere, die Anleihen gleichgestellt sind, die von einem Eurozonen-Mitgliedstaat der Europäischen Union ausgegeben oder garantiert wurden, wie festverzinsliche und variabel verzinsliche Anleihen.

Zur Erreichung seines Anlageziels kann sich der Teilfonds außerdem in begrenztem Umfang einer Vielzahl von (i) Instrumenten bedienen, insbesondere Zinsterminkontrakte, Devisenterminkontrakte (einschließlich nicht lieferbarer Terminkontrakte), Zinsfutures, Anleihenfutures und OTC-Swaps, wie zum Beispiel Zins-Swaps und Credit Default Swaps, und (ii) Strategien, z. B. Antizipation von Zinsbewegungen, Positionierung auf der Zinskurve, Emittentenauswahl, relativer Handel und Währung.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen durch den Einsatz von Derivaten) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen.

Für den Teilfonds gelten die folgenden Beschränkungen:

- Maximales Engagement in festverzinslichen Wertpapieren europäischer Emittenten außerhalb der Eurozone: 20 %
- Maximales Engagement in festverzinslichen Wertpapieren von Emittenten aus Industrieländern außerhalb Europas: 20 %
- Maximales Engagement in Wandelanleihen: 20 %
- Maximales Engagement an High-Yield- und Schwellenmärkten: 30 %
- Maximales Engagement in Geldmarktinstrumenten: 30 %
- Maximales Engagement in nicht bewerteten Wertpapieren: 10 %
- Maximales Engagement in ABS/MBS: 20 %
- Bandbreite der Duration: +/- 2 Jahre (im Vergleich zum Referenzportfolio)
- Maximales Engagement im Währungsrisiko: 10 %
- Maximale Allokation in Aktien: 10 %

Die Allokation in Aktien ergibt sich aus der Wandlung von Wandelanleihen in Aktien. Der Manager ist nicht befugt, aktiv Aktienwerte zu erwerben.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur die Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene Vermögenswerte anlegen, doch er darf bis zu 10 % des Nettovermögens des Teilfonds in notleidende Vermögenswerte anlegen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Im Rahmen des ESG-Ansatzes der Verwaltungsgesellschaft und im Einklang mit den UN PRI schließt der Teilfonds Direktanlagen in Wertpapieren aus, die von Unternehmen ausgegeben werden, die an sehr umstrittenen Aktivitäten beteiligt sind (z. B. der Produktion von Tabak oder umstrittenen Waffen) und/oder schwerwiegend gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen.

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures), zu Anlagezwecken, zur Absicherung und zur effizienten Portfolioverwaltung;
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

Die Höhe des Engagements durch derivative Finanzinstrumente ist auf 100 % des Nettovermögens des Teilfonds begrenzt. Infolgedessen variiert das Engagement des Teilfonds von 0 bis 100 %.

## ABN AMRO Funds Insight Euro Aggregate Bonds Kurzbezeichnung ABN AMRO Insight Euro Aggregate Bonds

### Verhältnis zum Referenzportfolio

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### Externer Anlageverwalter

Insight Investment Management (Global) Limited.

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Kreditrisiko
- Derivatrisiko
- Gegenparteiisiko
- Risiken von Hochzinsanleihen
- Liquiditätsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU2054453407	Ja	Nein	Alle	100 EUR
	AUS	LU2257990676				
Klasse C	THES	LU2054453589	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse D	THES	LU2054453662	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU2054453746	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR

<sup>(1)</sup> Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	0,70 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,40 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,40 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,40 %	-	-	0,18 %	0,01 %

<sup>(1)</sup> Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

#### Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %

<sup>(1)</sup> Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

<b>ABN AMRO Funds Insight Euro Aggregate Bonds</b> <b>Kurzbezeichnung ABN AMRO Insight Euro Aggregate Bonds</b>
--

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 9. Juli 2020 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilinhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# **ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Insight Euro ESG Corporate Bonds**

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus auf Euro lautenden nachhaltigen Unternehmensanleihen, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Der Teilfonds verwendet eine Auswahl von Wertpapieren, die den Kriterien der ESG-Verantwortung (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung) entsprechen. Das Portfolio setzt sich aus Emittenten zusammen, die entweder eine führende Stellung im Bereich ESG-Best-Practice aufweisen oder aufgrund ihrer Fortschritte im Bereich ESG attraktiv sind.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv mittels eines Top-down- und Bottom-Up-Ansatzes verwaltet, unter Berücksichtigung umweltbezogener, sozialer und Unternehmensführungsfaktoren (ESG). Das daraus resultierende Portfolio umfasst drei hauptsächliche Performancetreiber: das Kreditrating, die Sektorallokation und die Titelauswahl im Markt für Unternehmenstitel. Jedoch können auch die Duration, die Zinsstrukturkurve und Währungen zusätzliche Renditequellen für die Strategie darstellen.

Der Teilfonds investiert vornehmlich in auf Euro lautende Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating und andere festverzinsliche und variabel verzinsliche Wertpapiere ohne Bewertungsbegrenzungen. Der Teilfonds kann sich außerdem einer Vielzahl von Instrumenten bedienen, um das Anlageziel des Teilfonds zu erreichen, insbesondere Zinsterminkontrakte, Devisenterminkontrakte (einschließlich nicht lieferbarer Terminkontrakte), Zinsfutures, Anleihefutures und OTC-Swaps, wie zum Beispiel Zins-Swaps und Credit Default Swaps und Strategien (z. B. Rendite- und Arbitragestrategien durch Anlagen in die vorstehend aufgelisteten Wertpapiere und Derivate).

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen.

Der Teilfonds wird innerhalb der verbleibenden 40 % seines Gesamtnettovermögens und auf konsolidierter Basis alle folgenden Beschränkungen für Anlagen in den nachfolgenden Wertpapieren/Instrumenten respektieren:

- (i) es dürfen maximal 25 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Wandelanleihen und sonstigen aktiengebundenen Schuldtiteln angelegt werden;
- (ii) es darf maximal ein Drittel des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Geldmarktinstrumenten, insbesondere Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten einschließlich Einlagenzertifikaten, kurzfristigen Einlagen und Sichtenanlagen, angelegt werden;
- (iii) es dürfen maximal 10 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in übertragbaren Anteilspapieren angelegt werden;
- (iv) es dürfen maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds angelegt werden, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

100 % der Anleihen im Portfolio werden einer nicht-finanziellen Analyse unterzogen. Lediglich die Positionen in Barmitteln und Bargeldfonds unterliegen nicht direkt einer nicht-finanziellen Analyse.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Diese werden überwiegend zu Absicherungszwecken eingesetzt. Die Anlage in Derivaten ist nicht das Hauptziel des Teilfonds und dient somit nicht dem Erreichen eines nachhaltigen Ziels und einer ESG-Analyse.

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw.

## ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Kurzbezeichnung ABN AMRO Insight Euro ESG Corporate Bonds

keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Die Berechnungsmethode des Referenzportfolios finden Sie auf der folgenden Website: [www.markit.com](http://www.markit.com).

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### Externer Anlageverwalter

Insight Investment Management (Global) Limited.

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Gegenparteirisiko
- Derivatrisiko
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1165274488	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse C	THES	LU1165274645	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse D	THES	LU1718321521	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1329508904	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR

<sup>(1)</sup> Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	0,70 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,40 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,40 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,40 %	-	-	0,18 %	0,01 %

<sup>(1)</sup> Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

#### Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %

<sup>(1)</sup> Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

<b>ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds</b> <b>Kurzbezeichnung ABN AMRO Insight Euro ESG Corporate Bonds</b>
--

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde in der „Klasse A“ und „Klasse C“ am 1. April 2015 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilinhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# **ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO JPMorgan Asia Pacific ESG Equities**

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus Aktien des pazifischen Marktes, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Der Teilfonds verwendet eine Auswahl von Wertpapieren, die den Kriterien der ESG-Verantwortung (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung) entsprechen. Das Portfolio setzt sich aus Emittenten zusammen, die entweder eine führende Stellung im Bereich ESG-Best-Practice aufweisen oder aufgrund ihrer Fortschritte im Bereich ESG attraktiv sind.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in der Pazifik-Region ausgegeben werden.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen durch den Einsatz von Derivaten) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds kann auch bis zu 10 % seines Nettovermögens in Schuldtitel (wie fest- und variabel verzinsliche Anleihen, Geldmarktinstrumente einschließlich Hochzinsanleihen) investieren, insbesondere zum Zwecke der Barmittelverwaltung. Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 90 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds darf bis zu 10 % seines Gesamt Nettovermögens in externe passive Fonds und/oder ETF investieren, die Artikel 6 der Offenlegungsverordnung entsprechen. Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Aktienindexfutures, Währungsfutures), zu Anlagezwecken, zur Absicherung und zur effizienten Portfolioverwaltung;

- OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).

Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Externer Anlageverwalter**

JPMorgan Asset Management (Europe).



## ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities Kurzbezeichnung ABN AMRO JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Betriebs- und Verwahrrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten
- Risiko von Optionsscheinen
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilskategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU2757517748 „Klasse A-EUR“ LU2757517664 „Klasse A-USD“	Ja	Nein	Alle	100 EUR  100 USD
	AUS	LU2757517581		Ja		100 GBP
Klasse R	THES	LU2757517409 „Klasse R-EUR“ LU2757517318 „Klasse R-USD“	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR  100 USD
	AUS	LU2757517235		Ja		100 GBP
Klasse C	THES	LU2757517151 „Klasse C-EUR“ LU2757517078 „Klasse C-USD“	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR  5.000 USD
Klasse I	THES	LU2757516930 „Klasse I-EUR“ LU2757516856 „Klasse I-USD“	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA  Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR  1.000.000 USD

<sup>(1)</sup> Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,50%	-	-	0,20%	0,05%
Klasse R	0,85%	-	-	0,20%	0,05%
Klasse C	0,85%	-	-	0,20%	0,05%
Klasse I	0,75%	-	-	0,20%	0,01%

<sup>(1)</sup> Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist.

#### Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00%	1,00%	1,00%
Klasse R	5,00%	1,00%	1,00%
Klasse C	5,00%	1,00%	1,00%
Klasse I	-	-	-

<sup>(1)</sup> Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

<b>ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities</b> <b>Kurzbezeichnung ABN AMRO JPMorgan Asia Pacific ESG Equities</b>
--

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

USD, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

USD in den Kategorien „Klasse A-USD“, „Klasse R-USD“, „Klasse C-USD“ und „Klasse I-USD“.  
 EUR in den Kategorien „Klasse A-EUR“, „Klasse R-EUR“, „Klasse C-EUR“ und „Klasse I-EUR“.

GBP in den Kategorien „Klasse A-GBP“ und „Klasse R-GBP“.

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal drei Bankgeschäftstage nach dem Bewertungstag (T+3) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wird zu einem noch durch den Verwaltungsrat festzulegenden Datum aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilinhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen ihrer Anlagen im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Kempen Euro Corporate Bonds

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus auf Euro lautenden Unternehmensanleihen, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vornehmlich in auf Euro lautende Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating und andere festverzinsliche und variabel verzinsliche Wertpapiere ohne Bewertungsbegrenzungen. Der Teilfonds kann sich außerdem einer Vielzahl von Instrumenten bedienen, um das Anlageziel des Teilfonds zu erreichen, insbesondere Zinsterminkontrakte, Devisenterminkontrakte (einschließlich nicht lieferbarer Terminkontrakte), Zinsfutures, Anleihenfutures und OTC-Swaps, wie zum Beispiel Zins-Swaps und Credit Default Swaps und Strategien (z. B. Rendite- und Arbitragestrategien durch Anlagen in die vorstehend aufgelisteten Wertpapiere und Derivate).

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen.

Der Teilfonds wird innerhalb der verbleibenden 40 % seines Gesamtnettovermögens und auf konsolidierter Basis alle folgenden Beschränkungen für Anlagen in den nachfolgenden Wertpapieren/Instrumenten respektieren:

- (i) es dürfen maximal 25 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Wandelanleihen (ausgenommen Pflichtwandelanleihen), sonstigen aktiengebundenen Schuldtiteln und Hochzinsanleihen angelegt werden;
- (ii) es darf maximal ein Drittel des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Geldmarktinstrumenten, insbesondere Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten, einschließlich Einlagenzertifikate, kurzfristige Einlagen und Sichteinlagen, angelegt werden;
- (iii) es dürfen maximal 10 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in übertragbaren Aktienwerten angelegt werden;
- (iv) es dürfen maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds angelegt werden, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 90 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds darf bis zu 10 % seines Gesamtnettovermögens in externe passive Fonds und/oder ETF investieren, die Artikel 6 der Offenlegungsverordnung entsprechen. Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Externer Anlageverwalter**

Kempen Capital Management N.V.

### **Risikoprofil**

**Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Gegenparteiisiko

## ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Kurzbezeichnung ABN AMRO Kempen Euro Corporate Bonds

- Derivatrisiko
- Risiken von Hochzinsanleihen
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1253565086	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse C	THES	LU1253565243	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
	AUS	LU2631872293	Ja	Ja		
Klasse D	THES	LU1670610952	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1329511874	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neufilze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

### Gebühren und Kosten

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	0,70 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,40 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,40 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,40 %	-	-	0,18 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

<b>ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds</b> <b>Kurzbezeichnung ABN AMRO Kempen Euro Corporate Bonds</b>
--

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 6. Oktober 2015 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Kempen Euro Corporate Bonds DH

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus auf Euro lautenden Unternehmensanleihen, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Des Weiteren wird der Teilfonds versuchen, die Auswirkungen steigender Zinssätze auf die Renditen zu minimieren.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vornehmlich in auf Euro lautende Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating und andere festverzinsliche und variabel verzinsliche Wertpapiere ohne Bewertungsbegrenzungen. Der Teilfonds kann sich außerdem einer Vielzahl von Instrumenten bedienen, um das Anlageziel des Teilfonds zu erreichen, insbesondere Zinsterminkontrakte, Devisenterminkontrakte (einschließlich nicht lieferbarer Terminkontrakte), Zinsfutures, Anleihenfutures und OTC-Swaps, wie zum Beispiel Zins-Swaps und Credit Default Swaps und Strategien (z. B. Rendite- und Arbitragestrategien durch Anlagen in die vorstehend aufgelisteten Wertpapiere und Derivate).

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen.

Der Teilfonds wird innerhalb der verbleibenden 40 % seines Gesamtvermögens und auf konsolidierter Basis alle folgenden Beschränkungen für Anlagen in den nachfolgenden Wertpapieren/Instrumenten respektieren:

- (i) es dürfen maximal 25 % des Gesamtvermögens des Teilfonds in Wandelanleihen (ausgenommen Pflichtwandelanleihen), sonstigen aktiengebundenen Schuldtiteln und Hochzinsanleihen angelegt werden;
- (ii) es darf maximal ein Drittel des Gesamtvermögens des Teilfonds in Geldmarktinstrumenten, insbesondere Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten, einschließlich Einlagenzertifikate, kurzfristige Einlagen und Sichteinlagen, angelegt werden;
- (iii) es dürfen maximal 10 % des Gesamtvermögens des Teilfonds in übertragbaren Aktienwerten angelegt werden;
- (iv) es dürfen maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds angelegt werden, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

Ziel des Teilfonds ist es, die Laufzeit mithilfe börsennotierter Derivate um die entsprechende Laufzeit des für den Teilfonds verwendeten Referenzportfolios zu verringern. Ein gewisses Laufzeitrisiko kann im Portfolio verbleiben und entspricht der aktiven Wette des Verwalters.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 90 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds darf bis zu 10 % seines Gesamtvermögens in externe passive Fonds und/oder ETF investieren, die Artikel 6 der Offenlegungsverordnung entsprechen. Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

# ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Kempen Euro Corporate Bonds DH

### Externer Anlageverwalter

Kempen Capital Management N.V.

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Gegenparteiisiko
- Derivatrisiko
- Risiken von Hochzinsanleihen
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1253565169	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse C	THES	LU1253565326	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse D	THES	LU1733877176	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1733877259	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	0,70 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,40 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,40 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,40 %	-	-	0,18 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

#### Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

**ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Kempen Euro Corporate Bonds DH**

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

„Klasse A“ und „Klasse C“ wurden nach ihrer Zusammenlegung mit sämtlichen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten der „Klasse AH DUR“ bzw. „Klasse CH DUR“ des Teilfonds „ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds“ der Gesellschaft am 9. März 2018 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.



# **ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Liontrust European Sustainable Equities**

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus nachhaltigen europäischen Aktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Der Teilfonds verwendet eine Kombination aus finanziellen und nicht-finanziellen Indikatoren, um Wertpapiere zu identifizieren, die die vom externen Anlageverwalter angewendeten allgemeinen Nachhaltigkeitskriterien erfüllen. Der Teilfonds wird sich aus Emittenten zusammensetzen, die in drei langfristigen, nachhaltigen Themenbereichen positiv engagiert sind, darunter (i) „bessere Ressourceneffizienz“, (ii) „Verbesserung der Gesundheit“ und (iii) „höhere Sicherheit und Belastbarkeit“, und gleichzeitig einen langfristigen Kapitalzuwachs bieten.

Das ökologisch nachhaltige Anlageziel des Teilfonds besteht darin, in Unternehmen zu investieren, die das Ziel unterstützen, bis zum Jahr 2050 netto keine Treibhausgasemissionen zu verursachen. Dies steht im Einklang mit der Verpflichtung der Net-Zero Asset Managers Initiative (NZAMI) des externen Anlageverwalters und den Zielen des Pariser Übereinkommens. Darüber hinaus investiert der Teilfonds im Rahmen seines sozialen nachhaltigen Investitionsziels in Unternehmen, die einen positiven Beitrag zu sozialen Lösungen leisten.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in Europa ausgegeben werden, oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen.

Der Teilfonds wird aktiv über ein Bottom-Up-Verfahren bei der Titelauswahl verwaltet. Das Team zielt darauf ab, langfristige nachhaltige Themen zu identifizieren, die das Wachstum von Unternehmen vorantreiben. Nach Ansicht des Anlageverwalters werden diese Unternehmen aufgrund ihrer Ausrichtung auf die Themen, ihres exzellenten Managements und ihrer soliden Fundamentaldaten starke Wachstumsaussichten aufweisen. Das Ergebnis ist ein Portfolio aus qualitativ hochwertigen Unternehmen mit 40 bis 60 angemessen bewerteten Positionen, wobei diese Spanne je nach den Marktbedingungen schwanken kann.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren beträgt 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor erfüllen und die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Anlagen in Schultiteln werden 15 % seines Nettovermögens nicht übersteigen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds trägt zu ökologischen und sozialen Zielen bei und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

Das nicht-finanzielle Verfahren deckt 100 % des Portfolios ab (Barmittel und Derivate werden nicht in die ESG-Analyse einbezogen). Das investierbare Universum wird nach der Umsetzung der Nachhaltigkeitsfilter um mindestens 20 % reduziert.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 9 geltenden Ausschlussbestimmungen ein. Der externe Anlageverwalter kann auch andere Ausschlüsse umsetzen. In dieser Hinsicht wird der externe Portfolioverwalter nicht in Unternehmen investieren, die ein strategisches Engagement im Nuklearbereich haben.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

## ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities Kurzbezeichnung ABN AMRO Liontrust European Sustainable Equities

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### Externer Anlageverwalter

Liontrust Investment Partners LLP

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Betriebs- und Verwahrrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten
- Risiko von Optionsscheinen
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilkategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU0849850747	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse R	THES	LU1890795757	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR
Klasse C	THES	LU0849850820	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse D	THES	LU1718323147	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1329512096	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU0849851042	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR
	AUS	LU2474253650		Ja		
Klasse Z	THES	LU1890796052	Ja	Nein	Zugelassene Anleger	100.000.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

### Gebühren und Kosten

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse R	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,85 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse I	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %
Klasse Z	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

## ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities Kurzbezeichnung ABN AMRO Liontrust European Sustainable Equities

Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse R	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-
Klasse Z	5,00 %	1,00 %	1,00 %

<sup>(1)</sup> Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

### **Zusätzliche Informationen**

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

#### **Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

<sup>(1)</sup> Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

#### **Notierung:**

Keine

#### **Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 23. April 2018 aufgelegt.

#### **Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# **ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Liontrust Global Impact Equities**

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus Aktien, deren Unternehmen einen messbaren sozioökonomischen oder umweltbezogenen Nutzen generieren, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Der Teilfonds verwendet eine Kombination aus finanziellen und nicht-finanziellen Indikatoren, um Wertpapiere zu identifizieren, die die vom externen Anlageverwalter angewendeten allgemeinen Nachhaltigkeitskriterien erfüllen. Mithilfe der Nachhaltigkeitskriterien sollen Unternehmen ermittelt werden, die positive ökologische und soziale Auswirkungen aufweisen und die den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung entsprechen. Gleichzeitig wird ein langfristiger Kapitalzuwachs angestrebt.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von weltweit ansässigen Unternehmen ausgegeben werden, oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen.

Der Teilfonds wird über ein Bottom-Up-Verfahren bei der Titelauswahl verwaltet. Das Team zielt darauf ab, langfristige nachhaltige Wirkungs-Themen zu identifizieren, die das Wachstum von Unternehmen im Hinblick auf die Erreichung der UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDG) vorantreiben. Das Ergebnis ist ein Portfolio aus qualitativ hochwertigen Unternehmen mit 30 bis 35 angemessen bewerteten Positionen, wobei diese Spanne je nach den Marktbedingungen schwanken kann.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor erfüllen und die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds kann auch bis zu 10 % seines Nettovermögens in Schuldtitel (wie fest und variabel verzinsliche Anleihen, Geldmarktinstrumente einschließlich Hochzinsanleihen) investieren, insbesondere zum Zwecke der Barmittelverwaltung.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds trägt zu ökologischen und sozialen Zielen bei und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

Das nicht-finanzielle Verfahren deckt 100 % der Wertpapiere im Portfolio ab (Barmittel und Derivate werden nicht in die ESG-Analyse einbezogen). Das investierbare Universum wird nach der Umsetzung der Nachhaltigkeitsfilter um mindestens 20 % reduziert.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 9 geltenden Ausschlussbestimmungen ein. Der externe Anlageverwalter kann auch andere Ausschlüsse umsetzen. In dieser Hinsicht wird der externe Portfolioverwalter nicht in Unternehmen investieren, die ein strategisches Engagement im Nuklearbereich haben.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures),
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

## ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities Kurzbezeichnung ABN AMRO Liontrust Global Impact Equities

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### Externer Anlageverwalter

Liontrust Investment Partners LLP

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Betriebs- und Verwahrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten
- Risiko von Optionsscheinen
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilkategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU2281293485	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse R	THES	LU2281293568	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR
Klasse C	THES	LU2281293725	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse D	THES	LU2281293998	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU2281294020	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU2281294293	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR
	AUS	LU2474253734		Ja		
Klasse Z	THES	LU2281294459	Ja	Nein	Zugelassene Anleger	100.000.000 EUR

<sup>(1)</sup> Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse R	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,85 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse I	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %
Klasse Z	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %

<sup>(1)</sup> Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

**ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Liontrust Global Impact Equities**

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse R	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-
Klasse Z	5,00 %	1,00 %	1,00 %

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 13. April 2021 aufgelegt.

Keine.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities

## Kurzbezeichnung ABN AMRO M&G Emerging Markets Equities

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus Schwellenmarktaktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv durch ein Bottom-Up-Verfahren bei der Titelauswahl verwaltet, bei dem ein quantitatives Screening (zur Verkleinerung des Anlageuniversums) mit einer Fundamentaldatenanalyse kombiniert wird. Ziel ist es, nach Ansicht des Anlageverwalters unterbewertete Unternehmen zu erkennen, die das Potenzial für eine langfristige Wertschöpfung haben. Das Ergebnis ist ein diversifiziertes Portfolio aus Unternehmen mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung (50 bis 70 Positionen, wobei diese Spanne je nach den Marktbedingungen schwanken kann), das auf den größten Überzeugungen des Anlageteams basiert.

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in Schwellenmärkten ausgegeben werden.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen durch den Einsatz von Derivaten) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Anlagen in Schuldtiteln werden 15 % seines Nettovermögens nicht übersteigen.

Der Teilfonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens über Shanghai-Hong Kong und Shenzhen Stock Connect in chinesische Aktien (A-Aktien) investieren, die auf CNH lauten und an der Hong Kong Stock Exchange notiert sind.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 75 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds darf bis zu 10 % seines Gesamt Nettovermögens in externe passive Fonds und/oder ETF investieren, die Artikel 6 der Offenlegungsverordnung entsprechen. Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds kann zum Zwecke eines höheren Engagements und zur Absicherung in Finanzderivaten anlegen.

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Externer Anlageverwalter**

M&G Investment Management Limited

### **Risikoprofil**

**Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Betriebs- und Verwahrisiko

## ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities Kurzbezeichnung ABN AMRO M&G Emerging Markets Equities

- Risiko von Schwellenmärkten
- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten
- Risiko von Optionsscheinen
- Spezifische Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in China
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilskategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1577878611 „Klasse A-EUR“	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse C	THES	LU1577878884 „Klasse C-EUR“ LU1577878967 „Klasse C-USD“	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR 5.000 USD
Klasse D	THES	LU1670612065	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1577879007	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neufilize OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU1577879189	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 USD

<sup>(1)</sup> Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

### Gebühren und Kosten

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	2,00 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse C	1,10 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse D	1,10 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse F	1,10 %	-	-	0,25 %	0,01 %
Klasse I	1,00 %	-	-	0,20 %	0,01 %

<sup>(1)</sup> Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

<sup>(1)</sup> Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

USD, Währung, auf die der Teilfonds lautet.



<b>ABN AMRO Funds M&amp;G Emerging Markets Equities</b> <b>Kurzbezeichnung ABN AMRO M&amp;G Emerging Markets Equities</b>
--

**Nettoinventarwert (NIW):**

USD in den Kategorien „Klasse C-USD“ und „Klasse I“.

EUR in den Kategorien „Klasse A-EUR“, „Klasse C-EUR“, „Klasse D“ und „Klasse F“.

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal drei Bankgeschäftstage nach dem Bewertungstag (T+3) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Dieser Teilfonds wurde am 21. November 2017 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds Numeric Emerging Market Equities

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Numeric Emerging Market Equities

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus Schwellenmarktaktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird nach einem rein quantitativen und systematischen Anlageverfahren verwaltet. Dieses Verfahren verwendet etwa 20 Marktsignale in Bezug auf die Bewertung (unter anderem: Gewinn, Aktienmomentum, Stilmomentum und Qualität) und den Informationsfluss, um die Unternehmen des Universums innerhalb ihrer Vergleichsgruppen zu bewerten. Das stark diversifizierte Portfolio (mindestens 150 Positionen, wobei diese Zahl je nach den Marktbedingungen schwanken kann) wird sodann mithilfe eines firmeneigenen Risikomodells aufgebaut, das die Rendite optimieren soll und gleichzeitig die Risikofaktoren gegenüber dem Referenzportfolio neutral hält.

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in Schwellenmärkten ausgegeben werden.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen durch den Einsatz von Derivaten) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Anlagen in Schuldtiteln werden 15 % seines Nettovermögens nicht übersteigen.

Der Teilfonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens über Shanghai-Hong Kong und Shenzhen Stock Connect in chinesische Aktien (A-Aktien) investieren, die auf CNH lauten und an der Hong Kong Stock Exchange notiert sind.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Im Rahmen des ESG-Ansatzes der Verwaltungsgesellschaft und im Einklang mit den UN PRI schließt der Teilfonds Direktanlagen in Wertpapieren aus, die von Unternehmen ausgegeben werden, die an sehr umstrittenen Aktivitäten beteiligt sind (z. B. der Produktion von Tabak oder umstrittenen Waffen) und/oder schwerwiegend gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen.

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds kann zum Zwecke eines höheren Engagements und zur Absicherung in Finanzderivaten anlegen.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

-notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Aktienindexfutures, Währungsfutures), zu Anlagezwecken, zur Absicherung und zur effizienten Portfolioverwaltung;

-OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).

Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Externer Anlageverwalter**

Numeric Investors LLC.

### **Risikoprofil**

#### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Betriebs- und Verwahrrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten

## ABN AMRO Funds Numeric Emerging Market Equities Kurzbezeichnung ABN AMRO Numeric Emerging Market Equities

- Risiko von Optionsscheinen
- Spezifische Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in China

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilkategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1165277820 „Klasse A-EUR“ LU1165278125 „Klasse A-USD“	Ja	Nein	Alle	100 EUR 100 USD
Klasse C	THES	LU1165278638 „Klasse C-EUR“ LU1165278802 „Klasse C-USD“	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR 5.000 USD
Klasse D	THES	LU1406019189	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1329509621	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU1181319671 „Klasse I-EUR“ LU1181318780 „Klasse I-USD“	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR 1.000.000 USD

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

### Gebühren und Kosten

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	2,00 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse C	1,10 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse D	1,10 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse F	1,10 %	-	-	0,25 %	0,01 %
Klasse I	1,00 %	-	-	0,20 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

USD, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

<b>ABN AMRO Funds Numeric Emerging Market Equities</b> <b>Kurzbezeichnung ABN AMRO Numeric Emerging Market Equities</b>
--

**Nettoinventarwert (NIW):**

USD in den Kategorien „Klasse A-USD“, „Klasse C-USD“ und „Klasse I-USD“.

EUR in den Kategorien „Klasse A-EUR“, „Klasse D“, „Klasse F“, „Klasse C-EUR“ und „Klasse I-EUR“.

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal drei Bankgeschäftstage nach dem Bewertungstag (T+3) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Dieser Teilfonds wurde am 1. April 2015 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilinhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen ihrer Anlagen im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

## **ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities**

### **Kurzbezeichnung ABN AMRO Parnassus US ESG Equities**

#### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus nachhaltigen US-Aktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Das Portfolio setzt sich aus Unternehmen zusammen, die in Bezug auf ESG-Best-Practices flexibel sind. Der Fonds strebt Anlagen in Unternehmen an, die eine positive Performance in Bezug auf ESG-Kriterien aufweisen.

#### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in Nordamerika ausgegeben werden, oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen.

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet; dies geschieht durch einen nachhaltigen Bottom-Up-Ansatz bei der Titelauswahl, um Unternehmen zu ermitteln, die nach Ansicht des Anlageverwalters erheblich unterbewertet sind und ein kompetentes Managementteam sowie einen deutlichen, langfristig relevanten Wettbewerbsvorteil aufweisen. Alle Unternehmen sollten die vom Portfolioverwalter und der Verwaltungsgesellschaft festgelegten Nachhaltigkeitskriterien erfüllen.

Das endgültige Portfolio ist relativ fokussiert (in der Regel 35 bis 45 Positionen, wobei diese Spanne je nach den Marktbedingungen schwanken kann) und wird nach vorgegebenen Diversifikationsrichtlinien aufgebaut.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Anlagen in Schuldtiteln werden 15 % seines Nettovermögens nicht übersteigen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

#### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

Die Nachhaltigkeitsanalyse deckt 100 % der Wertpapiere im Portfolio ab (Barmittel, Einlagen werden nicht in die ESG-Analyse einbezogen).

Nach Anwendung der Nachhaltigkeitsfilter (Ausschlüsse und ESG-Scoring) wird das unterste Quartil der Unternehmen aus dem investierbaren Universum ausgeschlossen. Daher weist das Portfolio einen besseren ESG-Score auf als das investierbare Universum.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

#### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds kann zu Zwecken der Anlage, effizienten Portfolioverwaltung oder Absicherung bis zu 10 % seines Nettovermögens in derivative Instrumente und andere Finanzinstrumente wie im Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben investieren.

#### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Die Berechnungsmethode des Referenzportfolios finden Sie auf der folgenden Website: [www.msci.com](http://www.msci.com).

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

<p style="text-align: center;"><b>ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities</b> <b>Kurzbezeichnung ABN AMRO Parnassus US ESG Equities</b></p>
--

**Externer Anlageverwalter**

Parnassus Investments.

**Risikoprofil**

**Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Risiko von Optionsscheinen
- Derivatrisiko
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

**Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

**Anteilskategorien**

**ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Parnassus US ESG Equities**

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1481505755 „Klasse A-EUR“ LU1481505672 „Klasse A-USD“	Ja	Nein	Alle	100 EUR
	AUS	LU1890797290 „Klasse A-GBP“		Ja		100 USD
Klasse AH EUR	THES	LU1890796136		Nein		100 GBP
Klasse R	THES	LU1670606760 „Klasse R-EUR“ LU1670606927 „Klasse R-USD“ LU2434831587 „Klasse R-GBP“	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR
	AUS	LU1670606844 „Klasse R-GBP“ LU2474253148 „Klasse R-USD“		Ja		100 USD
				Nein		100 GBP
Klasse RH EUR	THES	LU1890796300				100 EUR
Klasse C	THES	LU1481505839 „Klasse C-EUR“ LU2011271140 „Klasse C-USD“	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR 5.000 USD
Klasse D	THES	LU1586378710	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1481505912	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neufilze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU1890796482 „Klasse I-EUR“ LU1481506050 „Klasse I-USD“	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR
	AUS	LU1890796565 „Klasse I-GBP“		Ja		1.000.000 USD
Klasse IH EUR	THES	LU1890797027				1.000.000 GBP
Klasse X1	THES	LU1955039661 „Klasse X1-EUR“ LU1955039745 „Klasse X1-USD“	Ja	Nein	Zugelassene Anleger	50.000.000 EUR 50.000.000 USD

**ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Parnassus US ESG Equities**

	AUS	LU1955039828 „Klasse X1-GBP“		Ja		50.000.000 GBP
Klasse X1H	THES	LU2387327351 „Klasse X1H- EUR“	Ja	Nein	Zugelassene Anleger	50.000.000 EUR
Klasse Z	THES	LU1670607065	Ja	Nein	Zugelassene Anleger	100.000.000 USD

(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

**Gebühren und Kosten**

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungs- gebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klassen A, AH EUR	1,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klassen R, RH EUR	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,85 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klassen I, IH EUR	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %
Klasse X1, X1H	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %
Klasse Z	0,00 %	-	-	0,15 %	0,01 %

(1) Ferner kann die Gesellschaft der Besteuerung und/oder Regulierungsabgaben für ausländische OGA in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist.

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klassen A, AH EUR	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klassen R, RH EUR	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klassen I, IH EUR	-	-	-
Klasse X1, X1H	-	-	-
Klasse Z	5,00 %	1,00 %	1,00 %

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

USD, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

USD in den Kategorien „Klasse A-USD“, „Klasse C-USD“, „Klasse R-USD“, „Klasse C-USD“, „Klasse I-USD“, „Klasse X1-USD“ und „Klasse Z“.

EUR in den Kategorien „Klasse A-EUR“, „Klasse AH EUR“, „Klasse R-EUR“, „Klasse RH EUR“, „Klasse C-EUR“, „Klasse D“, „Klasse F“, „Klasse I-EUR“, „Klasse IH EUR“, „Klasse X1-EUR“ und „Klasse X1H-EUR“.

GBP in den Kategorien „Klasse A-GBP“, „Klasse R-GBP“, „Klasse I-GBP“ und „Klasse X1-GBP“.

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.



**ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Parnassus US ESG Equities**

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
13:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Dieser Teilfonds wurde am 19. Januar 2017 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

<p style="text-align: center;"><b>ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds</b> <b>Kurzbezeichnung ABN AMRO Portfolio High Quality Impact Bonds</b> <b>Kurzbezeichnung ABN AMRO Impact Euro Obligaties</b></p>
---

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus auf Euro lautenden nachhaltigen Aggregate Bonds, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

Der Teilfonds verfolgt eine multithematische nachhaltige Anlagestrategie. Das Portfolio wird sich aus Emittenten zusammensetzen, die sich den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDGs) verpflichtet haben und die SDG Solutions Assessment (SDGA)-Methodik von ISS berücksichtigen. Im Rahmen seines nachhaltigen Investitionsziels investiert der Teilfonds in Emittenten, die einen positiven Beitrag zu ökologischen und sozialen Lösungen leisten, darunter unter anderem grüne und soziale Anleihen.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vornehmlich in auf Euro lautende Anleihen mit Investment-Grade-Rating und andere festverzinsliche und variabel verzinsliche Wertpapiere. Der Teilfonds kann sich außerdem einer Vielzahl von Instrumenten bedienen, um das Anlageziel des Teilfonds zu erreichen, insbesondere Zinsterminkontrakte, Devisenterminkontrakte (einschließlich nicht lieferbarer Terminkontrakte), Zinsfutures, Anleihenfutures und OTC-Swaps, wie zum Beispiel Zins-Swaps und Credit Default Swaps und Strategien (z. B. Rendite- und Arbitragestrategien durch Anlagen in die vorstehend aufgelisteten Wertpapiere und Derivate).

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen durch den Einsatz von Derivaten) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen.

Der Teilfonds wird innerhalb der verbleibenden 40 % seines Gesamtvermögens und auf konsolidierter Basis alle folgenden Beschränkungen für Anlagen in den nachfolgenden Wertpapieren/Instrumenten respektieren:

- (i) es dürfen maximal 10 % des Gesamtvermögens des Teilfonds in Hochzinsanleihen angelegt werden;
- (ii) es dürfen maximal 25 % des Gesamtvermögens des Teilfonds in Wandelanleihen und sonstigen aktiengebundenen Schuldtiteln angelegt werden;
- (iii) es darf maximal ein Drittel des Gesamtvermögens des Teilfonds in Geldmarktinstrumenten, einschließlich unter anderem Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente einschließlich Einlagezertifikate, kurzfristige Einlagen und Sichteinlagen, angelegt werden;
- (iv) es dürfen maximal 10 % des Gesamtvermögens des Teilfonds in übertragbaren Anteilspapieren angelegt werden;
- (v) es dürfen maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds angelegt werden, die Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor erfüllen und in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene Vermögenswerte anlegen, doch er darf bis zu 10 % des Nettovermögens des Teilfonds in notleidende Vermögenswerte anlegen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds trägt zu ökologischen und sozialen Zielen bei und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

Die nicht-finanzielle Analyse deckt 100 % der Wertpapiere im Portfolio ab (Barmittel werden nicht in die Nachhaltigkeitsanalyse einbezogen).

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 9 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures), zu Anlagezwecken, zur Absicherung und zur effizienten Portfolioverwaltung;
- OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).

**ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Portfolio High Quality Impact Bonds**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Impact Euro Obligaties**

Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

**Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

**Anlageverwalter**

ABN AMRO Investment Solutions

**Externer Berater**

ABN AMRO Bank N.V.

**Risikoprofil**

**Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Gegenpartierisiko
- Kreditrisiko
- Derivatrisiko
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

**Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

**Anteilkategorien**

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse E	THES	LU2096463232 „Klasse E-CAP“	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung von ABN AMRO und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
	AUS	LU2096463315 „Klasse E-DIS“		Ja		
Klasse G	THES	LU2445655066	Ja	Ja	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe mit einer spezifischen Gebührenvereinbarung und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU2579956827	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter und OGA	1.000.000 EUR
Klasse R	AUS	LU2608637208	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

**ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Portfolio High Quality Impact Bonds**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Impact Euro Obligaties**

**Gebühren und Kosten**

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse E	0,50 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse G	0,80 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse I	0,45 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse R	0,55 %	-	-	0,18 %	0,05 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse E	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse G	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-
Klasse R	5,00 %	1,00 %	1,00 %

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 1. Oktober 2020 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilinhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Private Portfolio Bonds

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus auf Euro lautenden Anleihen, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vornehmlich in auf Euro lautende Anleihen mit Investment-Grade-Rating und andere festverzinsliche und variabel verzinsliche Wertpapiere. Der Teilfonds kann sich außerdem einer Vielzahl von Instrumenten bedienen, um das Anlageziel des Teilfonds zu erreichen, insbesondere Zinsterminkontrakte, Devisenterminkontrakte (einschließlich nicht lieferbarer Forwards), Zinsfutures und Anleihenfutures sowie Strategien (z. B. Rendite- und Arbitragestrategien durch Anlagen in den vorstehend aufgelisteten Wertpapieren und Derivaten). Die Mindest-Vermögensallokation in Investment-Grade-Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen.

Für den Teilfonds gelten die folgenden Beschränkungen:

- Mindestengagement in auf Euro lautenden Investment-Grade-Anleihen: 60 %
- Maximales Engagement in Wandelanleihen: 15 %
- Maximales Engagement in Hochzins-Schuldtiteln 10 %
- Maximales Engagement in Schwellenmarkt-Schuldtiteln: 10 %
- Maximales Engagement im Währungsrisiko: 20 %
- Maximale Allokation in Aktien: 10 %

Die Allokation in Aktien ergibt sich aus der Wandlung von Wandelanleihen in Aktien. Der Manager ist nicht befugt, aktiv Aktienwerte zu erwerben.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor erfüllen und die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur die Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene Vermögenswerte anlegen, doch er darf bis zu 10 % des Nettovermögens des Teilfonds in notleidende Vermögenswerte anlegen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 70 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds investiert nur in externe Fonds, die unter Artikel 8 oder 9 der Offenlegungsverordnung fallen oder über ein europäisches Nachhaltigkeitslabel verfügen. Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds kann versuchen, durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen zu minimieren. Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures), zu Zwecken der Anlage und der Absicherung;

- OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Referenzportfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

## ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds Kurzbezeichnung ABN AMRO Private Portfolio Bonds

Die Berechnungsmethode des Referenzportfolios finden Sie auf der folgenden Website: [www.bloomberg.com](http://www.bloomberg.com).

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### Anlageverwalter

ABN AMRO Investment Solutions

### Externer Berater

ABN AMRO Bank N.V. Niederlassung Belgien

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Gegenparteirisiko
- Kreditrisiko
- Derivatrisiko
- Liquiditätsrisiko
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilkategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU2229462127	Ja	Nein	Alle	100 EUR
	AUS	LU2229462390		Ja		
Klasse B	THES	LU2229462473	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
	AUS	LU2229462556		Ja		
Klasse I	THES	LU2229462630	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR
	AUS	LU2229462713		Ja		

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,00 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse B	0,60 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse I	0,50 %	-	-	0,15 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

#### Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse B	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

**ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Private Portfolio Bonds**

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR.

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

<b>Zentralisierung der Aufträge</b>	<b>Handelstag der Aufträge</b>	<b>Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW</b>	<b>Abwicklungstag der Aufträge</b>
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 9. Juli 2021 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilinhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

## **ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities**

### **Kurzbezeichnung ABN AMRO Private Portfolio Equities**

#### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus internationalen Aktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

#### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Aktienwerte von Unternehmen aus aller Welt (einschließlich der Schwellenmärkte) und allen Wirtschaftssektoren. Die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren beträgt 85 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Für den Teilfonds gelten die folgenden Beschränkungen:

- Mindestengagement in europäischen Aktien (ohne Schwellenmärkte): 30 %
- Maximales Engagement in Schwellenmärkten: 20 %
- Maximales Engagement in Small- und Mid-Caps: 20 %

Der Teilfonds wird nicht direkt in Aktien aus Festlandchina engagiert sein (jedoch ist ein indirektes Engagement über Anlagen in anderen Fonds möglich (diese sind auf 10 % des Nettovermögens begrenzt)).

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds kann auch bis zu 10 % seines Nettovermögens in Schuldtitel (wie fest und variabel verzinsliche Anleihen, Geldmarktinstrumente einschließlich Hochzinsanleihen) investieren, insbesondere zum Zwecke der Barmittelverwaltung.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

#### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 70 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds investiert nur in externe Fonds, die unter Artikel 8 oder 9 der Offenlegungsverordnung fallen oder über ein europäisches Nachhaltigkeitslabel verfügen. Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

#### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds kann auf nicht komplexe Positionen auf derivative Finanzinstrumente oder auf derivative Finanzinstrumente zurückgreifen, die nur zu Absicherungszwecken verwendet werden.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Aktienindexfutures, Währungsfutures);
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

#### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Die Berechnungsmethode des Referenzportfolios finden Sie auf der folgenden Website: [www.msci.com](http://www.msci.com).

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.



# ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Private Portfolio Equities

### Anlageverwalter

ABN AMRO Investment Solutions

### Externer Berater

ABN AMRO Bank N.V. Niederlassung Belgien

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Betriebs- und Verwahrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, Risiko von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten
- Derivatrisiko
- Liquiditätsrisiko
- Gegenparteiisiko
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilkategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU2229462804	Ja	Nein	Alle	100 EUR
	AUS	LU2229462986		Ja		
Klasse B	THES	LU2229463018	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
	AUS	LU2229463109		Ja		
Klasse I	THES	LU2229463281	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR
	AUS	LU2229463364		Ja		

<sup>(1)</sup> Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,90 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse B	1,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse I	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %

<sup>(1)</sup> Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

#### Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse B	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

<sup>(1)</sup> Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

### Zusätzliche Informationen

#### Rechnungs- und Referenzwährung:

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

## ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

### Kurzbezeichnung ABN AMRO Private Portfolio Equities

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 9. Juli 2021 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilinhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Putnam US ESG Equities

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus nachhaltigen US-Aktien durch die Auswahl von Wachstumsunternehmen, die den ESG-Kriterien (Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) entsprechen, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in den USA ausgegeben werden, oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen durch den Einsatz von Derivaten) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds kann bis zu 10 % in ADR/GDR investieren.

Der Teilfonds kann maximal 10 % seines Nettovermögens in zulässige OGAW anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur die zulässigen OGAW mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds kann auch bis zu 10 % seines Nettovermögens in Schuldtitel (wie fest und variabel verzinsliche Anleihen, Geldmarktinstrumente einschließlich Hochzinsanleihen) investieren, insbesondere zum Zwecke der Barmittelverwaltung.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Das Auswahlverfahren führt dazu, dass mindestens 20 % der Unternehmen aus dem investierbaren Universum entfernt werden.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein. Diesbezüglich investiert der externe Portfolioverwalter nicht in Unternehmen mit einem strategischen Engagement im Kernbrennstoffkreislauf (Schwellenwert von 5 % des Gesamtumsatzes).

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Aktienindexfutures, Währungsfutures);
- OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).

Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Externer Anlageverwalter**

The Putnam Advisory Company, LLC

## ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

### Kurzbezeichnung ABN AMRO Putnam US ESG Equities

#### Risikoprofil

##### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Risiko von Optionsscheinen
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

#### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilkategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

#### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU2546365920 „Klasse A-EUR“ LU2546367975 „Klasse A-USD“	Ja	Nein	Alle	100 EUR  100 USD
Klasse R	THES	LU2546367892 „Klasse R-EUR“ LU2546367629 „Klasse R-USD“	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR  100 USD
Klasse C	THES	LU2546367546	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU2546367462 „Klasse I-USD“ LU2546367389 „Klasse I-EUR“	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 USD  1.000.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

#### Gebühren und Kosten

##### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse R	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse I	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

##### Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse R	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

#### Zusätzliche Informationen

##### Rechnungs- und Referenzwährung:

USD, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

## ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

### Kurzbezeichnung ABN AMRO Putnam US ESG Equities

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

USD in den Kategorien „Klasse A-USD“, „Klasse R-USD“ und „Klasse I-USD“.

EUR in den Kategorien „Klasse A-EUR“, „Klasse R-EUR“, „Klasse C“ und „Klasse I-EUR“.

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

#### **Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
13:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

#### **Notierung:**

Keine

#### **Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 14. Dezember 2022 aufgelegt.

#### **Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# **ABN AMRO Funds Pzena European Equities**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Pzena European Equities**

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus europäischen Aktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet; dies geschieht durch einen reinen Bottom-Up-Ansatz bei der Titelauswahl, der quantitatives Screening und detaillierte Fundamentalanalyse kombiniert, um Unternehmen mit starken und einfachen Geschäftsmodellen zu ermitteln, die nach Ansicht des Anlageverwalters einen hohen Bewertungsabschlag bieten. Das Ergebnis ist ein relativ konzentriertes Deep-Value-Portfolio (in der Regel 40 bis 50 Positionen, wobei diese Spanne je nach den Marktbedingungen schwanken kann), das die höchsten Überzeugungen des Teams in Unternehmen mit hoher und mittlerer Kapitalisierung widerspiegelt. Das Portfolio des Teilfonds kann erheblich von den Sektor- und Ländergewichtungen des Referenzportfolios abweichen.

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in Europa ausgegeben werden, oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren beträgt 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Anlagen in Schuldtiteln werden 15 % seines Nettovermögens nicht übersteigen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Im Rahmen des ESG-Ansatzes der Verwaltungsgesellschaft und im Einklang mit den UN PRI schließt der Teilfonds Direktanlagen in Wertpapieren aus, die von Unternehmen ausgegeben werden, die an sehr umstrittenen Aktivitäten beteiligt sind (z. B. der Produktion von Tabak oder umstrittenen Waffen) und/oder schwerwiegend gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen.

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Externer Anlageverwalter**

Pzena Investment Management, LLC.

### **Risikoprofil**

#### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Betriebs- und Verwaltrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, Risiko von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten
- Risiko von Optionsscheinen

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### **Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

**ABN AMRO Funds Pzena European Equities**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Pzena European Equities**

**Anteilkategorien**

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES AUS	LU0849850408 „Klasse A-EUR“	Ja	Nein	Alle	100 EUR
		LU1670607149 „Klasse A-SEK“				1.000 SEK
		LU1890797704 „Klasse A-USD“				100 USD
		LU1313464684 „Klasse A-GBP“				100 GBP
Klasse R	THES	LU1670607495 „Klasse R-EUR“ LU1890797886 „Klasse R-USD“	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR 100 USD
	AUS THES	LU2075325501 „Klasse R-EUR DIS“ LU1670607578 „Klasse R-GBP“ LU1890797456		Ja Nein		100 EUR 100 GBP 100 EUR
Klasse C	THES	LU0849850580	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse D	THES	LU1406019262	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1329507419	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU0949827314 „Klasse I-EUR“ LU1670607222 „Klasse I-SEK“ LU1890797969 „Klasse I-USD“	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR 10.000.000 SEK 1.000.000 USD
	AUS THES	LU1313464924 „Klasse I-GBP“ LU2474253817 „Klasse I-EUR“ LU1890797530		Ja Nein		1.000.000 GBP 1.000.000 EUR 1.000.000 EUR
Klasse S1	AUS	LU1890797613	Ja	Nein	Zugelassene Anleger	20.000.000 EUR
Klasse X1	THES	LU2613669592	Ja	Nein	Zugelassene Anleger	50.000.000 EUR
Klasse Z	THES	LU1670607651	Ja	Nein	Zugelassene Anleger	100.000.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

## ABN AMRO Funds Pzena European Equities Kurzbezeichnung ABN AMRO Pzena European Equities

### Gebühren und Kosten

Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse R	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,85 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse I	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %
Klasse S1	0,75 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse X1	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %
Klasse Z	0,00 %	-	-	0,15 %	0,01 %

<sup>(1)</sup> Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse R	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-
Klasse S1	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse X1	-	-	-
Klasse Z	5,00 %	1,00 %	1,00 %

<sup>(1)</sup> Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

EUR in den Kategorien „Klasse A-EUR“, „Klasse R-EUR“, „Klasse C“, „Klasse D“, „Klasse F“, „Klasse I-EUR“, „Klasse S1“, „Klasse Z“ und „Klasse X1“.

GBP in den Kategorien „Klasse A-GBP“, „Klasse R-GBP“ und „Klasse I-GBP“.

SEK in den Kategorien „Klasse A-SEK“ und „Klasse I-SEK“.

USD in den Kategorien „Klasse A-USD“, „Klasse R-USD“ und „Klasse I-USD“.

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

#### **Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

<sup>(1)</sup> Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.



**ABN AMRO Funds Pzena European Equities**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Pzena European Equities**

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Dieser Teilfonds wurde am 4. April 2013 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

## **ABN AMRO Funds Pzena US Equities**

### **Kurzbezeichnung ABN AMRO Pzena US Equities**

#### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus US-Aktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

#### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet. Dies geschieht durch einen reinen Bottom-Up-Ansatz bei der Titelauswahl, der quantitatives Screening und detaillierte Fundamentalanalyse kombiniert, um Unternehmen mit starken und einfachen Geschäftsmodellen zu ermitteln, die nach Ansicht des Anlageverwalters einen hohen Bewertungsabschlag bieten. Das Ergebnis ist ein konzentriertes Deep-Value-Portfolio (in der Regel 30 bis 40 Positionen, wobei diese Spanne je nach den Marktbedingungen schwanken kann), das die höchsten Überzeugungen des Teams in Unternehmen mit hoher und mittlerer Kapitalisierung widerspiegelt.

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in Nordamerika ausgegeben werden, oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Anlagen in Schuldtiteln werden 15 % seines Nettovermögens nicht übersteigen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

#### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Im Rahmen des ESG-Ansatzes der Verwaltungsgesellschaft und im Einklang mit den UN PRI schließt der Teilfonds Direktanlagen in Wertpapieren aus, die von Unternehmen ausgegeben werden, die an sehr umstrittenen Aktivitäten beteiligt sind (z. B. der Produktion von Tabak oder umstrittenen Waffen) und/oder schwerwiegend gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen.

#### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

#### **Externer Anlageverwalter**

Pzena Investment Management, LLC.

#### **Risikoprofil**

##### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Risiko von Optionsscheinen

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

#### **Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

**ABN AMRO Funds Pzena US Equities**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Pzena US Equities**

**Anteilkategorien**

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU0979881538 „Klasse A-EUR“ LU0979881611 „Klasse A-USD“ LU1670607735 „Klasse A-SEK“	Ja	Nein	Alle	100 EUR  100 USD  1.000 SEK
	AUS	LU1890798934 „Klasse A-GBP“		Ja		100 GBP
Klasse AH EUR	THES	LU1890798009		Nein		100 EUR
Klasse R	THES	LU1670608113 „Klasse R-EUR“ LU1670608469 „Klasse R-USD“	Ja	Nein	Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger	100 EUR  100 USD
	AUS	LU1670608204 „Klasse R-GBP“		Ja		100 GBP
Klasse RH EUR	THES	LU1890798348		Nein		100 EUR
Klasse C	THES	LU0979881702	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse D	THES	LU1406019346	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1329508573	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neufilze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU0979881884 „Klasse I-USD“ LU1670607909 „Klasse I-EUR“ LU1670608030 „Klasse I-SEK“	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 USD  1.000.000 EUR  10.000.000 SEK
	AUS	LU1670607818 „Klasse I-GBP“		Ja Nein		1.000.000 GBP
Klasse IH EUR	THES	LU1670608626				1.000.000 EUR
Klasse X1	THES	LU2337064427	Ja		Zugelassene Anleger	50.000.000 USD
Klasse Z	THES	LU1670608543	Ja		Zugelassene Anleger	100.000.000 USD

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

## ABN AMRO Funds Pzena US Equities Kurzbezeichnung ABN AMRO Pzena US Equities

### Gebühren und Kosten

Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungs- gebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klassen A, AH EUR	1,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klassen R, RH EUR	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,85 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klassen I, IH EUR	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %
Klasse X1	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %
Klasse Z	0,00 %	-	-	0,15 %	0,01 %

(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klassen A, AH EUR	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klassen R, RH EUR	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klassen I, IH EUR	-	-	-
Klasse X1	-	-	-
Klasse Z	5,00 %	1,00 %	1,00 %

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

USD, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

USD in den Kategorien „Klasse A-USD“, „Klasse R-USD“, „Klasse I-USD“, „Klasse X1“ und „Klasse Z“.

EUR in den Kategorien „Klasse A-EUR“, „Klasse AH EUR“, „Klasse R-EUR“, „Klasse RH EUR“, „Klasse C“, „Klasse D“, „Klasse F“, „Klasse I-EUR“ und „Klasse IH EUR“.

GBP in den Kategorien „Klasse A-GBP“, „Klasse R-GBP“ und „Klasse I-GBP“.

SEK in den Kategorien „Klasse A-SEK“ und „Klasse I-SEK“.

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

#### **Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
13:00 Uhr MEZ am NIW- Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

#### **Notierung:**

Keine

#### **Historische Informationen:**

Dieser Teilfonds wurde am 5. Dezember 2013 aufgelegt.

**ABN AMRO Funds Pzena US Equities**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Pzena US Equities**

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-related Bonds

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Robeco Euro ESG Government-related Bonds

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalwachstums mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus Anleihen regierungsnaher Emittenten mit Investment-Grade-Rating, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds investiert vorwiegend in auf Euro lautende Anleihen regierungsnaher Emittenten mit Investment-Grade-Rating und wie Anleihen behandelte Wertpapiere, die von einem der Eurozone angehörenden Mitgliedstaat der Europäischen Union ausgegeben oder garantiert werden, wie fest und variabel verzinsliche Anleihen, sowie in Derivate auf diesen Anlagentyp.

Die Mindestanlage des Teilfonds in solchen Wertpapieren beträgt 60 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Sollte ein Wertpapier auf ein Non-Investment-Grade-Rating oder ein notleidendes Wertpapier herabgestuft werden, hält der Teilfonds es bis zu maximal 10 % im Portfolio. Wenn diese Grenze überschritten wird, wird das Wertpapier so bald wie möglich unter Berücksichtigung der Interessen der Anleger des Teilfonds verkauft.

Zusätzlich zu den oben aufgeführten Beschränkungen wird der Teilfonds innerhalb der übrigen 40 % seines Gesamtnettovermögens und auf konsolidierter Basis alle folgenden Beschränkungen für Anlagen in den nachfolgenden Wertpapieren/Instrumenten respektieren, die insgesamt ein Drittel seines Gesamtnettovermögens nicht übersteigen dürfen:

- (i) es dürfen maximal 40 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in andere auf Euro oder nicht auf Euro lautende Anleihen mit Investment-Grade-Status angelegt werden;
- (ii) es darf maximal ein Drittel des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Geldmarktinstrumenten angelegt werden;
- (iii) es dürfen maximal 10 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Aktien oder Anteilen anderer OGAW oder OGA angelegt werden.

Für den Teilfonds gelten auch die folgenden Beschränkungen:

- Maximales Engagement in nicht bewerteten Wertpapieren: 10 %
- Bandbreite der Duration: +/- 2 Jahre (im Vergleich zum Referenzportfolio)
- Maximales Engagement im Währungsrisiko: 10 %

Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene Vermögenswerte investieren.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 90 % des Portfolios ab.

Der ESG-Auswahlprozess (Ausschlüsse und ESG-Screenings) wird dazu führen, dass mindestens 20 % des anfänglichen Universums von den Anlagen ausgeschlossen werden, da diese Anlagen nicht qualifiziert sind (Ausschlüsse, erreichte ESG-Ratings).

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures), zu Anlagezwecken, zur Absicherung und zur effizienten Portfolioverwaltung;
- OTC-Instrumente zur Währungsanlage, zu Absicherungszwecken und für ein effizientes Portfoliomanagement (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

## ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-related Bonds Kurzbezeichnung ABN AMRO Robeco Euro ESG Government-related Bonds

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### Externer Anlageverwalter

Robeco Institutional Asset Management B.V.

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Derivatrisiko
- Nachhaltigkeitsrisiko
- Risiken von Hochzinsanleihen

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilskategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1577879775	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse C	AUS	LU1577879858	Ja	Ja	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse D	THES	LU1577880195	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1577880278	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	0,60 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,35 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,35 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,35 %	-	-	0,18 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

#### Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

### Zusätzliche Informationen

#### Rechnungs- und Referenzwährung:

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-related Bonds**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Robeco Euro ESG Government-related Bonds**

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Auflegungsdatum:**

**Historische Informationen:**

Dieser Teilfonds wurde am 30. Oktober 2017 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilinhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.



# **ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Sands Emerging Markets Equities**

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus Schwellenmarktaktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird durch einen auf Fundamentaldaten und das Geschäft ausgerichteten Bottom-up-/Stockpicking-Ansatz verwaltet. Ziel ist es, qualitativ hochwertige Wachstumsunternehmen zu identifizieren, die in attraktiven Wachstumsbranchen führend sind und diese dominieren. Das Ergebnis ist ein relativ konzentriertes Portfolio (40 Aktien, was jedoch je nach den Marktbedingungen schwanken kann), das hauptsächlich in Aktien mit hoher Marktkapitalisierung investiert ist und die stärksten Überzeugungen des Teams widerspiegelt. Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in Schwellenmärkten ausgegeben werden.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen durch den Einsatz von Derivaten) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens sin Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Anlagen in Schuldtiteln werden 10 % seines Nettovermögens nicht übersteigen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 75 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds darf bis zu 10 % seines Gesamtnettovermögens in externe passive Fonds und/oder ETF investieren, die Artikel 6 der Offenlegungsverordnung entsprechen. Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Aktienindexfutures, Währungsfutures), zu Anlagezwecken, zur Absicherung und zur effizienten Portfolioverwaltung;
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Externer Anlageverwalter**

Sands Capital Management, LLC.

## ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities Kurzbezeichnung ABN AMRO Sands Emerging Markets Equities

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Betriebs- und Verwahrrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten
- Risiko von Optionsscheinen
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilskategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU2054455527 „Klasse A-EUR“ LU2054455790 „Klasse A-USD“	Ja	Nein	Alle	100 EUR
	AUS	LU2054455873 „Klasse A-GBP“		Ja		100 USD
Klasse R	THES	LU2054455956 „Klasse R-EUR“ LU2054456095 „Klasse R-USD“	Ja	Nein		Anleger, die Kunden von Finanzintermediären oder Finanzdienstleistern sind, denen der Erhalt von Anreizen untersagt ist, und zugelassene Anleger
	AUS	LU2054456178 „Klasse R-GBP“		Ja	100 USD	
Klasse C	THES	LU2054456418 „Klasse C-EUR“ LU2054456509 „Klasse C-USD“	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	
						5.000 EUR
Klasse D	THES	LU2054456681	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 USD
Klasse F	THES	LU2054456764	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neufilze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU2054456848 „Klasse I-EUR“	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR
		LU2054456921 „Klasse I-USD“				1.000.000 USD
Klasse IH	THES	LU2474253908 „Klasse IH-EUR“	Ja	Nein		

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

# ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Sands Emerging Markets Equities

### Gebühren und Kosten

Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	2,00 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse R	1,10 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse C	1,10 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse D	1,10 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse F	1,10 %	-	-	0,25 %	0,01 %
Klasse I	1,00 %	-	-	0,20 %	0,01 %
Klasse IH	1,00 %	-	-	0,20 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse R	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-
Klasse IH	-	-	-

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

USD, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

USD in den Kategorien „Klasse A-USD“, „Klasse R-USD“, „Klasse C-USD“, und „Klasse I-USD“. EUR in den Kategorien „Klasse A-EUR“, „Klasse R-EUR“, „Klasse C-EUR“, „Klasse D“, „Klasse F“, „Klasse I-EUR“ und „Klasse IH-EUR“.

GBP in den Kategorien „Klasse A-GBP“ und „Klasse R-GBP“.

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

#### **Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal drei Bankgeschäftstage nach dem Bewertungstag (T+3) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

#### **Notierung:**

Keine

#### **Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 22. Mai 2020 aufgelegt.

#### **Besteuerung:**

Potenziellen Anteilinhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen ihrer Anlagen im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# **ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Schroder Euro Corporate ESG Bonds**

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus auf Euro lautenden Unternehmensanleihen, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Der Teilfonds verwendet eine Auswahl von Wertpapieren, die den Kriterien der ESG-Verantwortung (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung) entsprechen. Das Portfolio setzt sich aus Emittenten zusammen, die entweder eine führende Stellung im Bereich ESG-Best-Practice aufweisen oder aufgrund ihrer Fortschritte im Bereich ESG attraktiv sind.

### **Anlagepolitik**

Der Fonds wird aktiv durch einen Prozess verwaltet, der eine Analyse von Makro-Themen und eine Bottom-up-Auswahl kombiniert. Das Ergebnis ist ein Portfolio, das unkorrelierte Alphaquellen vereint, um das Risiko zu minimieren.

Der Teilfonds investiert vornehmlich in auf Euro lautende Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating und andere festverzinsliche und variabel verzinsliche Wertpapiere. Der Teilfonds kann sich außerdem einer Vielzahl von Instrumenten/Strategien bedienen, um das Anlageziel des Teilfonds zu erreichen, insbesondere Zinsterminkontrakte, Devisenterminkontrakte (einschließlich nicht lieferbarer Terminkontrakte), Zinsfutures, Anleihenfutures und OTC-Swaps, wie zum Beispiel Zins-Swaps und Credit Default Swaps.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen.

Der Teilfonds wird innerhalb der verbleibenden 40 % seines Gesamtnettovermögens und auf konsolidierter Basis alle folgenden Beschränkungen für Anlagen in den nachfolgenden Wertpapieren/Instrumenten respektieren:

- (i) es dürfen maximal 25 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Wandelanleihen und sonstigen aktiengebundenen Schuldtiteln angelegt werden;
- (ii) es darf maximal ein Drittel des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Geldmarktinstrumenten, insbesondere Einlagezertifikaten, kurzfristigen Einlagen und Sichteinlagen angelegt werden;
- (iii) es dürfen maximal 10 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in übertragbaren Anteilspapieren angelegt werden;

(iv) es dürfen maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds angelegt werden, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 90 % des Portfolios ab. Der ESG-Auswahlprozess (Ausschlüsse und ESG-Screenings) wird dazu führen, dass mindestens 20 % des anfänglichen Universums von den Anlagen ausgeschlossen werden, da diese Anlagen nicht qualifiziert sind (Ausschlüsse, erreichte ESG-Ratings).

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures), zu Anlagezwecken, zur Absicherung und zur effizienten Portfolioverwaltung;
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw.

## ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Kurzbezeichnung ABN AMRO Schroder Euro Corporate ESG Bonds

keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Die Berechnungsmethode des Referenzportfolios finden Sie auf der folgenden Website: [www.markit.com](http://www.markit.com).

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### Externer Anlageverwalter

Die deutsche Niederlassung von Schroder Investment Management (Europe) S.A., an die Schroder Investment Management Ltd. die Anlageverwaltung des Portfolios delegiert hat

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Gegenparteirisiko
- Derivatrisiko
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilkategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU0979879557	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse C	THES	LU0979879631	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
	AUS	LU2631872376	Ja	Ja		
Klasse D	THES	LU1670610796	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1329508490	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU0979879987	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klasse A	0,70 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,40 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,40 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,40 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse I	0,35 %	-	-	0,15 %	0,01 %

*(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.*

*(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

**ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Schroder Euro Corporate ESG Bonds**

Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr <sup>(2)</sup>	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr <sup>(2)</sup>
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Dieser Teilfonds wurde am 5. Dezember 2013 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Schroder Euro Corporate ESG Bonds DH

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus auf Euro lautenden Unternehmensanleihen, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Des Weiteren wird der Teilfonds auch versuchen, die Auswirkungen steigender Zinssätze auf die Renditen zu minimieren. Der Teilfonds verwendet eine Auswahl von Wertpapieren, die den Kriterien der ESG-Verantwortung (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung) entsprechen. Das Portfolio setzt sich aus Emittenten zusammen, die entweder eine führende Stellung im Bereich ESG-Best-Practice aufweisen oder aufgrund ihrer Fortschritte im Bereich ESG attraktiv sind.

### **Anlagepolitik**

Der Fonds wird aktiv durch einen Prozess verwaltet, der eine Analyse von Makro-Themen und eine Bottom-up-Auswahl kombiniert. Das Ergebnis ist ein Portfolio, das unkorrelierte Alphaquellen vereint, um das Risiko zu minimieren.

Der Teilfonds investiert vornehmlich in auf Euro lautende Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating und andere festverzinsliche und variabel verzinsliche Wertpapiere. Der Teilfonds kann sich außerdem einer Vielzahl von Instrumenten/Strategien bedienen, um das Anlageziel des Teilfonds zu erreichen, insbesondere Zinsterminkontrakte, Devisenterminkontrakte (einschließlich nicht lieferbarer Terminkontrakte), Zinsfutures, Anleihenfutures und OTC-Swaps, wie zum Beispiel Zins-Swaps und Credit Default Swaps.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen.

Der Teilfonds wird innerhalb der verbleibenden 40 % seines Gesamtnettovermögens und auf konsolidierter Basis alle folgenden Beschränkungen für Anlagen in den nachfolgenden Wertpapieren/Instrumenten respektieren:

- (i) es dürfen maximal 25 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Wandelanleihen und sonstigen aktiengebundenen Schuldtiteln angelegt werden;
- (ii) es darf maximal ein Drittel des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Geldmarktinstrumenten, insbesondere Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten einschließlich Einlagenzertifikaten, kurzfristigen Einlagen und Sichtenanlagen, angelegt werden;
- (iii) es dürfen maximal 10 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in übertragbaren Anteilspapieren angelegt werden;

(iv) es dürfen maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds angelegt werden, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

Ziel des Teilfonds ist es, die Laufzeit mithilfe börsennotierter Derivate, um die entsprechende Laufzeit des für den Teilfonds verwendeten Referenzportfolios zu verringern. Ein gewisses Laufzeitrisiko kann im Portfolio verbleiben und entspricht der aktiven Wette des Verwalters.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 90 % des Portfolios ab. Der ESG-Auswahlprozess (Ausschlüsse und ESG-Screenings) wird dazu führen, dass mindestens 20 % des anfänglichen Universums von den Anlagen ausgeschlossen werden, da diese Anlagen nicht qualifiziert sind (Ausschlüsse, erreichte ESG-Ratings).

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures), zu Anlagezwecken, zur Absicherung und zur effizienten Portfolioverwaltung;
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

# ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Schroder Euro Corporate ESG Bonds DH

### Verhältnis zum Referenzportfolio

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Die Berechnungsmethode des Referenzportfolios finden Sie auf der folgenden Website: [www.theice.com](http://www.theice.com).

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### Externer Anlageverwalter

Die deutsche Niederlassung von Schroder Investment Management (Europe) S.A., an die Schroder Investment Management Ltd. die Anlageverwaltung des Portfolios delegiert hat

### Risikoprofil

#### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Gegenparteirisiko
- Derivatrisiko
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilskategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1253567454	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse C	THES	LU0979879714	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse D	THES	LU1733877333	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1733877416	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

### Gebühren und Kosten

#### **Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klasse A	0,70 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,40 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,40 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,40 %	-	-	0,18 %	0,01 %

*(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.*

*(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*



**ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Schroder Euro Corporate ESG Bonds DH**

Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr <sup>(2)</sup>	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr <sup>(2)</sup>
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

„Klasse A“ und „Klasse C“ wurden nach ihrer Zusammenlegung mit sämtlichen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten der „Klasse AH DUR“ bzw. „Klasse CH DUR“ des Teilfonds „ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate Bonds“ der Gesellschaft am 9. März 2018 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilinhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

**ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO RBC BlueBay Euro Government Bonds**

# **ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Walter Scott European ESG Equities**

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus europäischen Aktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Der Teilfonds verwendet eine Auswahl von Wertpapieren, die den Kriterien der ESG-Verantwortung (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung, „ESG“) entsprechen. Das Portfolio setzt sich aus Emittenten zusammen, die entweder eine führende Stellung im Bereich ESG-Praktiken aufweisen oder aufgrund ihrer Fortschritte im Bereich ESG attraktiv sind.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird durch einen langfristigen und auf Fundamentaldaten ausgerichteten Bottom-up-Ansatz verwaltet, der auf der Aufzinsung von Renditen basiert. Der Teilfonds ist bestrebt, in Unternehmen zu investieren, die starke interne Renditen erwirtschaften und zu angemessenen Kaufpreisen erhältlich sind.

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in Europa ausgegeben werden, oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds kann auch bis zu 10 % seines Nettovermögens in Schuldtitel (wie fest und variabel verzinsliche Anleihen, Geldmarktinstrumente einschließlich Hochzinsanleihen) investieren, insbesondere zum Zwecke der Barmittelverwaltung.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 90 % des Portfolios ab. Der ESG-Auswahlprozess (Ausschlüsse und ESG-Screenings) wird dazu führen, dass mindestens 20 % des anfänglichen Universums von den Anlagen ausgeschlossen werden.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Aktienindexfutures, Währungsfutures);
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Externer Anlageverwalter**

Walter Scott & Partners Limited

## ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities Kurzbezeichnung ABN AMRO Walter Scott European ESG Equities

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten
- Risiko von Optionsscheinen
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilkategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU2281296587	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse C	THES	LU2281296660	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse D	THES	LU2281296744	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU2281296827	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neufilize OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU2281297049	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,85 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse I	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

#### Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

### Zusätzliche Informationen

#### Rechnungs- und Referenzwährung:

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

<b>ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities</b> <b>Kurzbezeichnung ABN AMRO Walter Scott European ESG Equities</b>
--

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 11. März 2021 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilinhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

**TEIL II DES PROSPEKTS**

**FUND OF MANDATES**

# ABN AMRO Funds Fund of Mandates Pacific Equities

## Kurzbezeichnung AAF FoM Pacific Equities

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus Strategien auf der Grundlage von Aktien aus dem Pazifikraum, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und investiert in verschiedene Strategien, die an mehrere Anlageverwalter delegiert sind. Der Teilfonds erlaubt eine Aufteilung zwischen verschiedenen Stilen und Marktkapitalisierungsstrategien im Pazifikraum. Der Auswahlprozess für diese externen Anlageverwalter stützt sich auf eine quantitative Performance- und Risikoanalyse, eine qualitative Bewertung von 5 Bereichen (Managementteam, Researchteam, Philosophie, Prozess- und Risikomanagement) und eine operative Due-Diligence-Prüfung.

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit im Pazifikraum ausgegeben werden, oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens über Shanghai-Hong Kong und Shenzhen Stock Connect in chinesische Aktien (A-Aktien) investieren, die auf CNH lauten und an der Hong Kong Stock Exchange notiert sind.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Anlagen in Schuldtiteln werden 15 % seines Nettovermögens nicht übersteigen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Im Rahmen des ESG-Ansatzes der Verwaltungsgesellschaft und im Einklang mit den UN PRI schließt der Teilfonds Direktanlagen in Wertpapieren aus, die von Unternehmen ausgegeben werden, die an sehr umstrittenen Aktivitäten beteiligt sind (z. B. der Produktion von Tabak oder umstrittenen Waffen) und/oder schwerwiegend gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen.

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

Die Auswahl der zugrunde liegenden Strategien und die Zusammensetzung des Portfolios werden nicht durch die Komponenten des Referenzportfolios definiert oder eingeschränkt. Der Manager wird nicht versuchen, die Höhe der Abweichung des Portfolios in Bezug auf das Referenzportfolio zu begrenzen. Aufgrund der Tatsache, dass der Teilfonds mehrere aktive Strategien auf diskretionärer Basis kombiniert, wird das Risiko- und Ertragsprofil des Teilfonds jedoch mit dem des Referenzportfolios vergleichbar sein. Die Abweichung der Rendite zwischen dem Fonds und dem Referenzportfolio (der Tracking Error) des Teilfonds wird voraussichtlich moderat sein.

### **Risikoprofil**

#### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Betriebs- und Verwahrrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten
- Risiken in Verbindung mit Anlagen in Asien
- Risiko von Optionsscheinen
- Spezifische Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in China

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

## ABN AMRO Funds Fund of Mandates Pacific Equities Kurzbezeichnung AAF FoM Pacific Equities

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilskategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU0321539412 „Klasse A-EUR“ LU0321538521 „Klasse A-USD“	Ja	Nein	Alle	100 EUR 100 USD
Klasse C	THES	LU0756530183 „Klasse C-EUR“ LU1075916053 „Klasse C-USD“	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR 5.000 USD
Klasse D	THES	LU1670611844	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1329513144	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

### Gebühren und Kosten

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	2,00 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klassen C	1,10 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse D	1,10 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse F	1,10 %	-	-	0,25 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klassen C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

USD, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

USD in den Kategorien „Klasse A-USD“, „Klasse C-USD“

EUR den Kategorien „Klasse A-EUR“, „Klasse C-EUR“, „Klasse D“ und „Klasse F“

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.



**ABN AMRO Funds Fund of Mandates Pacific Equities**  
**Kurzbezeichnung AAF FoM Pacific Equities**

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal drei Bankgeschäftstage nach dem Bewertungstag (T+3) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 2. November 2007 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds Fund of Mandates Emerging Market Equities

## Kurzbezeichnung AAF FoM Emerging Market Equities

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus Strategien auf der Grundlage von Schwellenmarktaktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und investiert in verschiedene Strategien, die an mehrere Anlageverwalter delegiert sind. Der Teilfonds erlaubt eine Aufteilung zwischen verschiedenen Stilen und Marktkapitalisierungsstrategien in Schwellenländern. Der Auswahlprozess für diese externen Anlageverwalter stützt sich auf eine quantitative Performance- und Risikoanalyse, eine qualitative Bewertung von 5 Bereichen (Managementteam, Researchteam, Philosophie, Prozess- und Risikomanagement) und eine operative Due-Diligence-Prüfung.

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in Schwellenmärkten ausgegeben werden.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen durch den Einsatz von Derivaten) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens über Shanghai-Hong Kong und Shenzhen Stock Connect in chinesische Aktien (A-Aktien) investieren, die auf CNH lauten und an der Hong Kong Stock Exchange notiert sind.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Anlagen in Schuldtiteln werden 15 % seines Nettovermögens nicht übersteigen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Im Rahmen des ESG-Ansatzes der Verwaltungsgesellschaft und im Einklang mit den UN PRI schließt der Teilfonds Direktanlagen in Wertpapieren aus, die von Unternehmen ausgegeben werden, die an sehr umstrittenen Aktivitäten beteiligt sind (z. B. der Produktion von Tabak oder umstrittenen Waffen) und/oder schwerwiegend gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen.

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds kann zum Zwecke eines höheren Engagements und zur Absicherung in Finanzderivaten anlegen.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

-notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Aktienindexfutures, Währungsfutures), zu Anlagezwecken, zur Absicherung und zur effizienten Portfolioverwaltung;

-OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).

Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

Die Auswahl der zugrunde liegenden Strategien und die Zusammensetzung des Portfolios werden nicht durch die Komponenten des Referenzportfolios definiert oder eingeschränkt. Der Manager wird nicht versuchen, die Höhe der Abweichung des Portfolios in Bezug auf das Referenzportfolio zu begrenzen. Aufgrund der Tatsache, dass der Teilfonds mehrere aktive Strategien auf diskretionärer Basis kombiniert, wird das Risiko- und Ertragsprofil des Teilfonds jedoch mit dem des Referenzportfolios vergleichbar sein. Die Abweichung der Rendite zwischen dem Fonds und dem Referenzportfolio (der Tracking Error) des Teilfonds wird voraussichtlich moderat sein.

### **Risikoprofil**

#### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Betriebs- und Verwahrrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten

## ABN AMRO Funds Fund of Mandates Emerging Market Equities Kurzbezeichnung AAF FoM Emerging Market Equities

- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten
- Risiko von Optionsscheinen
- Spezifische Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in China

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilskategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1165263440 „Klasse A-EUR“	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse C	THES	LU1165263952 „Klasse C-EUR“ LU1165264174 „Klasse C-USD“	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR 5.000 USD
Klasse D	THES	LU1670611760	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1329512252	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU1165264331 „Klasse I-EUR“ LU1165264505 „Klasse I-USD“	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR 1.000.000 USD

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	2,00 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse C	1,10 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse D	1,10 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse F	1,10 %	-	-	0,25 %	0,01 %
Klasse I	1,00 %	-	-	0,20 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

#### Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

USD, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

<b>ABN AMRO Funds Fund of Mandates Emerging Market Equities</b> <b>Kurzbezeichnung AAF FoM Emerging Market Equities</b>
--

**Nettoinventarwert (NIW):**

USD in den Kategorien „Klasse A-USD“, Klasse C-USD“ und „Klasse I-USD“.

EUR in den Kategorien „Klasse A-EUR“, „Klasse C-EUR“, „Klasse D“, „Klasse F“ und „Klasse I-EUR“.

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal drei Bankgeschäftstage nach dem Bewertungstag (T+3) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Dieser Teilfonds wurde am 1. April 2015 aufgelegt.

Keine

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilinhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

## Kurzbezeichnung AAF FoM Euro Corporate Bonds

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus Strategien auf der Grundlage von auf Euro lautenden Unternehmensanleihen, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und investiert in verschiedene Strategien, die an mehrere Anlageverwalter delegiert sind. Der Teilfonds erlaubt eine Aufteilung zwischen verschiedenen Marktstrategien in auf Euro lautenden Anleihen. Der Auswahlprozess für diese externen Anlageverwalter stützt sich auf eine quantitative Performance- und Risikoanalyse, eine qualitative Bewertung von 5 Bereichen (Managementteam, Researchteam, Philosophie, Prozess- und Risikomanagement) und eine operative Due-Diligence-Prüfung.

Der Teilfonds investiert vornehmlich in auf Euro lautende Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating und andere festverzinsliche und variabel verzinsliche Wertpapiere ohne Bewertungsbegrenzungen. Der Teilfonds kann sich außerdem einer Vielzahl von Instrumenten bedienen, um das Anlageziel des Teilfonds zu erreichen, insbesondere Zinsterminkontrakte, Devisenterminkontrakte (einschließlich nicht lieferbarer Terminkontrakte), Zinsfutures, Anleihenfutures und OTC-Swaps, wie zum Beispiel Zins-Swaps und Credit Default Swaps und Strategien (z. B. Rendite- und Arbitragestrategien durch Anlagen in die vorstehend aufgelisteten Wertpapiere und Derivate).

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen.

Der Teilfonds wird innerhalb der verbleibenden 40 % seines Gesamtnettovermögens und auf konsolidierter Basis alle folgenden Beschränkungen für Anlagen in den nachfolgenden Wertpapieren/Instrumenten respektieren:

- (i) es dürfen maximal 25 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Wandelanleihen und sonstigen aktiengebundenen Schuldtiteln angelegt werden;
- (ii) es darf maximal ein Drittel des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Geldmarktinstrumenten, insbesondere Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten einschließlich Einlagenzertifikaten, kurzfristigen Einlagen und Sichteinlagen, angelegt werden;
- (iii) es dürfen maximal 10 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in übertragbaren Anteilspapieren angelegt werden;
- (iv) es dürfen maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds angelegt werden, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 70 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds darf bis zu 10 % seines Gesamtnettovermögens in externe passive Fonds und/oder ETF investieren, die Artikel 6 der Offenlegungsverordnung entsprechen. Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures), zu Anlagezwecken, zur Absicherung und zur effizienten Portfolioverwaltung;
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

# ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

## Kurzbezeichnung AAF FoM Euro Corporate Bonds

### Verhältnis zum Referenzportfolio

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Gegenparteirisiko
- Derivatrisiko
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilskategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1165265148	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse C	THES	LU1165265494	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse D	THES	LU1670610440	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1329512419	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neufilize OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU1165265908	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klasse A	0,70 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,40 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,40 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,40 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse I	0,35 %	-	-	0,15 %	0,01 %

*(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.*

*(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

**ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds**  
**Kurzbezeichnung AAF FoM Euro Corporate Bonds**

Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr <sup>(2)</sup>	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr <sup>(2)</sup>
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

**Notierung:**

Keine

**Auflegungsdatum:**

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 1. April 2015 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged

## Kurzbezeichnung AAF FoM Euro Corporate Bonds DH

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus Strategien auf der Grundlage von auf Euro lautenden Unternehmensanleihen, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Des Weiteren wird der Teilfonds auch versuchen, die Auswirkungen steigender Zinssätze auf die Renditen zu minimieren.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und investiert in verschiedene Strategien, die an mehrere Anlageverwalter delegiert sind. Der Teilfonds erlaubt eine Aufteilung zwischen verschiedenen Marktstrategien in auf Euro lautenden Anleihen. Der Auswahlprozess für diese externen Anlageverwalter stützt sich auf eine quantitative Performance- und Risikoanalyse, eine qualitative Bewertung von 5 Bereichen (Managementteam, Researchteam, Philosophie, Prozess- und Risikomanagement) und eine operative Due-Diligence-Prüfung.

Der Teilfonds investiert vornehmlich in auf Euro lautende Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating und andere festverzinsliche und variabel verzinsliche Wertpapiere ohne Bewertungsbegrenzungen. Der Teilfonds kann sich außerdem einer Vielzahl von Instrumenten bedienen, um das Anlageziel des Teilfonds zu erreichen, insbesondere Zinsterminkontrakte, Devisenterminkontrakte (einschließlich nicht lieferbarer Terminkontrakte), Zinsfutures, Anleihenfutures und OTC-Swaps, wie zum Beispiel Zins-Swaps und Credit Default Swaps und Strategien (z. B. Rendite- und Arbitragestrategien durch Anlagen in die vorstehend aufgelisteten Wertpapiere und Derivate).

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen.

Der Teilfonds wird innerhalb der verbleibenden 40 % seines Gesamtnettovermögens und auf konsolidierter Basis alle folgenden Beschränkungen für Anlagen in den nachfolgenden Wertpapieren/Instrumenten respektieren:

- (i) es dürfen maximal 25 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Wandelanleihen und sonstigen aktiengebundenen Schuldtiteln angelegt werden;
- (ii) es darf maximal ein Drittel des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Geldmarktinstrumenten, insbesondere Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten einschließlich Einlagenzertifikaten, kurzfristigen Einlagen und Sichteinlagen, angelegt werden;
- (iii) es dürfen maximal 10 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in übertragbaren Anteilspapieren angelegt werden;
- (iv) es dürfen maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds angelegt werden, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

Ziel des Teilfonds ist es, die Laufzeit mithilfe börsennotierter Derivate um die entsprechende Laufzeit des für den Teilfonds verwendeten Referenzportfolios zu verringern. Ein gewisses Laufzeitrisiko kann im Portfolio verbleiben und entspricht der aktiven Wette des Verwalters.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 70 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds darf bis zu 10 % seines Gesamtnettovermögens in externe passive Fonds und/oder ETF investieren, die Artikel 6 der Offenlegungsverordnung entsprechen. Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures), zu Anlagezwecken, zur Absicherung und zur effizienten Portfolioverwaltung;



## ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged Kurzbezeichnung AAF FoM Euro Corporate Bonds DH

- OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte). Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### Verhältnis zum Referenzportfolio

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### Risikoprofil

#### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Gegenparteirisiko
- Derivatrisiko
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilskategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1253565755	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse C	THES	LU1165265650	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse D	THES	LU1733877507	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1733877689	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

### Gebühren und Kosten

#### **Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klasse A	0,70 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse C	0,40 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,40 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,40 %	-	-	0,18 %	0,01 %

*(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.*

*(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

**ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged  
Kurzbezeichnung AAF FoM Euro Corporate Bonds DH**

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr <sup>(2)</sup>	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr <sup>(2)</sup>
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

„Klasse A“ und „Klasse C“ wurden nach ihrer Zusammenlegung mit sämtlichen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten der „Klasse AH DUR“ bzw. „Klasse CH DUR“ des Teilfonds „ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds“ der Gesellschaft am 9. März 2018 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds Fund of Mandates North American Equities

## Kurzbezeichnung AAF FoM North American Equities

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus Strategien auf der Grundlage von US-Aktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und investiert in verschiedene Strategien, die an mehrere Anlageverwalter delegiert sind. Der Teilfonds erlaubt eine Aufteilung zwischen verschiedenen Stilen und Marktkapitalisierungsstrategien in Nordamerika. Der Auswahlprozess für diese externen Anlageverwalter stützt sich auf eine quantitative Performance- und Risikoanalyse, eine qualitative Bewertung von 5 Bereichen (Managementteam, Researchteam, Philosophie, Prozess- und Risikomanagement) und eine operative Due-Diligence-Prüfung.

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in Nordamerika ausgegeben werden, oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds darf maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds anlegen, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Anlagen in Schuldtiteln werden 15 % seines Nettovermögens nicht übersteigen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Im Rahmen des ESG-Ansatzes der Verwaltungsgesellschaft und im Einklang mit den UN PRI schließt der Teilfonds Direktanlagen in Wertpapieren aus, die von Unternehmen ausgegeben werden, die an sehr umstrittenen Aktivitäten beteiligt sind (z. B. der Produktion von Tabak oder umstrittenen Waffen) und/oder schwerwiegend gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen.

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

Die Auswahl der zugrunde liegenden Strategien und die Zusammensetzung des Portfolios werden nicht durch die Komponenten des Referenzportfolios definiert oder eingeschränkt. Der Manager wird nicht versuchen, die Höhe der Abweichung des Portfolios in Bezug auf das Referenzportfolio zu begrenzen. Aufgrund der Tatsache, dass der Teilfonds mehrere aktive Strategien auf diskretionärer Basis kombiniert, wird das Risiko- und Ertragsprofil des Teilfonds jedoch mit dem des Referenzportfolios vergleichbar sein. Die Abweichung der Rendite zwischen dem Fonds und dem Referenzportfolio (der Tracking Error) des Teilfonds wird voraussichtlich moderat sein.

### **Risikoprofil**

#### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Risiko von Optionsscheinen

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### **Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

**ABN AMRO Funds Fund of Mandates North American Equities**  
**Kurzbezeichnung AAF FoM North American Equities**

**Anteilkategorien**

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU0321538950 „Klasse A-EUR“	Ja	Nein	Alle	100 EUR
		LU0321538281 „Klasse A-USD“				100 USD
Klasse C	THES	LU0756530696 „Klasse C-EUR“	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
		LU1075916210 „Klasse C-USD“				5.000 USD
Klasse CH EUR	THES	LU0756530779	Ja	Nein		5.000 EUR
Klasse D	THES	LU1670609517	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1329512849	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU1165272516 „Klasse I-EUR“	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

**Gebühren und Kosten**

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klassen C, CH EUR	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse D	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,85 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse I	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klassen C, CH EUR	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse D	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	Keine	Keine	Keine

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

USD, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

USD in den Kategorien „Klasse A-USD“ und „Klasse C-USD“

EUR in den Kategorien „Klasse A-EUR“, „Klasse C-EUR“, „Klasse CH EUR“, „Klasse D“, „Klasse F“ und „Klasse I-EUR“.

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

<b>ABN AMRO Funds Fund of Mandates North American Equities</b> <b>Kurzbezeichnung AAF FoM North American Equities</b>
--

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
13:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 2. November 2007 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

## **ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds** **Kurzbezeichnung AAF Portfolio Flexible Bonds**

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus Strategien auf der Grundlage von Anleihen, darunter Schwellenland- und Hochzinsanleihen, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und investiert in verschiedene Strategien, die an mehrere Anlageverwalter delegiert sind. Der Teilfonds erlaubt eine Aufteilung zwischen verschiedenen Marktstrategien und geografischen Gebieten in Anleihemärkten. Der Auswahlprozess für diese externen Anlageverwalter stützt sich auf eine quantitative Performance- und Risikoanalyse, eine qualitative Bewertung von 5 Bereichen (Managementteam, Researchteam, Philosophie, Prozess- und Risikomanagement) und eine operative Due-Diligence-Prüfung.

Der Teilfonds investiert vornehmlich und diskretionär in Schuldtitel von Emittenten (ohne Rating-Beschränkungen) aus der ganzen Welt einschließlich Schwellenmärkten und High Yield-Anleihen (zwischen 0 % und 100 % des Nettovermögens des Teilfonds). Der Teilfonds kann sich außerdem einer Vielzahl von Instrumenten/Strategien bedienen, um das Anlageziel des Teilfonds zu erreichen, einschließlich, jedoch nicht beschränkt auf Geldmarktinstrumente, Wandelanleihen, Zinsterminkontrakte, Devisenterminkontrakte (einschließlich nicht lieferbarer Terminkontrakte), Zinsfutures, Anleihenfutures und OTC-Swaps, wie zum Beispiel Zins-Swaps und Credit Default Swaps.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen.

Der Teilfonds wird innerhalb der verbleibenden 40 % seines Gesamtnettovermögens und auf konsolidierter Basis alle folgenden Beschränkungen für Anlagen in den nachfolgenden Wertpapieren/Instrumenten respektieren:

- (i) maximal 10 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds dürfen in übertragbare Aktienwerte investiert werden.
- (ii) maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds, die gemäß einer Reihe qualitativer und quantitativer Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene Vermögenswerte anlegen, doch er darf bis zu 10 % des Nettovermögens des Teilfonds in notleidende Vermögenswerte anlegen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 70 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds darf investieren:

- bis zu 10 % seines Gesamtnettovermögens in externe passive oder quantitative Fonds und/oder ETF, die gemäß Art. 6 der Offenlegungsverordnung klassifiziert sind, wobei das investierbare Anlageuniversum den Ausschlüssen gemäß Art. 6 der Verwaltungsgesellschaft entspricht (Verweis auf Teil 1);
- bis zu 10 % seines Gesamtnettovermögens in externe passive Fonds und/oder ETF, die Artikel 6 der Offenlegungsverordnung entsprechen.

Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures), zu Anlagezwecken, zur Absicherung und zur effizienten Portfolioverwaltung;

## ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds Kurzbezeichnung AAF Portfolio Flexible Bonds

- OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte). Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### Verhältnis zum Referenzportfolio

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Gegenparteirisiko
- Derivatrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Zinsrisiko
- Wechselkursrisiko
- Risiken von Hochzinsanleihen
- Liquiditätsrisiko
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU1165266542	Ja	Nein	Alle	100 EUR
Klasse CH-USD	THES	LU1165267862	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 USD
	AUS	LU1670611505		Ja		
Klasse C	THES	LU1165270908	Ja	Nein		5.000 EUR
	AUS	LU1670611687		Ja		
Klasse DH-USD	THES	LU1670611331	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Bethmann Bank und zugelassene Anleger sind	5.000 USD
Klasse D	THES	LU1670611414	Ja	Nein		5.000 EUR
Klasse F	THES	LU1329512682	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neufilize OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse G	AUS	LU2445655140	Ja	Ja	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe mit einer spezifischen Gebührenvereinbarung und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR

<sup>(1)</sup> Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

## ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds Kurzbezeichnung AAF Portfolio Flexible Bonds

### Gebühren und Kosten

Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungs- gebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klasse A	1,30 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klassen C, CH USD	0,75 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klassen D, DH USD	0,75 %	-	-	0,25 %	0,05 %
Klasse F	0,75 %	-	-	0,25 %	0,01 %
Klasse G	1,30 %	-	-	0,25 %	0,01 %

(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.

(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungs- gebühr <sup>(2)</sup>	Umtausch- gebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahme- gebühr <sup>(2)</sup>
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klassen C, CH USD	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klassen D, DH USD	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse G	5,00 %	1,00 %	1,00 %

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

USD in den Kategorien „Klasse CH-USD“ und „Klasse DH-USD“

EUR in den Kategorien „Klasse A“, „Klasse C“, „Klasse D“, „Klasse F“ und „Klasse G“

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

#### **Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

#### **Notierung:**

Keine

#### **Historische Informationen:**

Dieser Teilfonds wurde am 1. April 2015 aufgelegt.

#### **Besteuerung:**

Potenziellen Anteilinhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.



# ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Portfolio Flexible ESG Bonds

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus Strategien auf der Grundlage von Anleihen, darunter Schwellenland- und Hochzinsanleihen, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und investiert in verschiedene Strategien, die an mehrere Anlageverwalter delegiert sind. Der Teilfonds erlaubt eine Aufteilung zwischen verschiedenen Marktstrategien und geografischen Gebieten in Anleihemärkten. Der Auswahlprozess für diese externen Anlageverwalter stützt sich auf eine quantitative Performance- und Risikoanalyse, eine qualitative Bewertung von 5 Bereichen (Managementteam, Researchteam, Philosophie, Prozess- und Risikomanagement) und eine operative Due-Diligence-Prüfung.

Der Teilfonds investiert vornehmlich und diskretionär in Schuldtitel von Emittenten (ohne Rating-Beschränkungen) aus der ganzen Welt einschließlich Schwellenmärkten und High Yield-Anleihen (zwischen 0 % und 100 % des Nettovermögens des Teilfonds). Der Teilfonds kann sich außerdem einer Vielzahl von Instrumenten/Strategien bedienen, um das Anlageziel des Teilfonds zu erreichen, einschließlich, jedoch nicht beschränkt auf Geldmarktinstrumente, Wandelanleihen, Zinsterminkontrakte, Devisenterminkontrakte (einschließlich nicht lieferbarer Terminkontrakte), Zinsfutures, Anleihenfutures und OTC-Swaps, wie zum Beispiel Zins-Swaps und Credit Default Swaps.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen.

Der Teilfonds wird innerhalb der verbleibenden 40 % seines Gesamtnettovermögens und auf konsolidierter Basis alle folgenden Beschränkungen für Anlagen in den nachfolgenden Wertpapieren/Instrumenten respektieren:

- (i) maximal 10 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds dürfen in übertragbare Aktienwerte investiert werden.
- (ii) maximal 10 % seines Nettovermögens in Fonds, die gemäß einer Reihe qualitativer und quantitativer Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene Vermögenswerte anlegen, doch er darf bis zu 10 % des Nettovermögens des Teilfonds in notleidende Vermögenswerte anlegen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 90 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds investiert nur in externe Fonds, die unter Artikel 8 oder 9 der Offenlegungsverordnung fallen oder über ein europäisches Nachhaltigkeitslabel verfügen. Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures), zu Anlagezwecken, zur Absicherung und zur effizienten Portfolioverwaltung;
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

## ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

### Kurzbezeichnung ABN AMRO Portfolio Flexible ESG Bonds

#### Verhältnis zum Referenzportfolio

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

#### Risikoprofil

##### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Gegenpartierisiko
- Derivatrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Zinsrisiko
- Wechselkursrisiko
- Risiken von Hochzinsanleihen
- Liquiditätsrisiko
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

#### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

#### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse G	THES	LU2445655223	Ja	Ja	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe mit einer spezifischen Gebührenvereinbarung und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

#### Gebühren und Kosten

##### **Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klasse G	1,30 %	-	-	0,25 %	0,01 %

*(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.*

*(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

##### **Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr <sup>(2)</sup>	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr <sup>(2)</sup>
Klasse G	5,00 %	1,00 %	1,00 %

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

#### Zusätzliche Informationen

##### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

##### **Nettoinventarwert (NIW):**

EUR in der Kategorie „Klasse G“.

## ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

### Kurzbezeichnung ABN AMRO Portfolio Flexible ESG Bonds

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wird zu einem noch durch den Verwaltungsrat festzulegenden Datum aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

## **TEIL II DES PROSPEKTS**

# **PROFILE**

**ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds 1**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profile Fund Very Defensive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds Zeer Defensief**

**Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus verschiedenen Anlageklassen, die eine breite Risikostreuung bieten, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

**Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv zwischen verschiedenen Anlageklassen verwaltet, wobei eine vom Anlageausschuss beschlossene strategische und taktische Allokation beachtet wird. Der Fonds erlaubt Engagements in Anlageklassen, geografischen Gebieten, Marktkapitalisierungen und Stilen durch verschiedene Anlageverwalter, die aufgrund ihrer Kompetenzen in einer bestimmten Strategie ausgewählt wurden. Der Auswahlprozess für diese externen Anlageverwalter stützt sich auf eine quantitative Performance- und Risikoanalyse, eine qualitative Bewertung von 5 Bereichen (Managementteam, Researchteam, Philosophie, Prozess- und Risikomanagement) und eine operative Due-Diligence-Prüfung.

Der Teilfonds kann in Anleihen, Aktien, Geldmarktinstrumenten über direkte Anlagen, Finanzderivate sowie Organismen für gemeinsame Anlagen (einschließlich börsennotierter Fonds) investieren. Der Teilfonds kann darüber hinaus über Organismen für gemeinsame Anlagen wie ETF und ETC mit einem maximalen Engagement von 10 % im Rohstoff- und Goldmarkt engagiert sein. Der Schwerpunkt liegt auf einer internationalen Diversifizierung der Anlagen.

Der Teilfonds ist bestrebt, durch eine aktive Verwaltung eines Portfolios aus übertragbaren Wertpapieren bei einem sehr niedrigen Risikoniveau eine Rendite zu erzielen.

Der Verwalter wird versuchen, ein sehr defensives Risikoprofil beizubehalten. Er wird verzinsliche Wertpapiere mit verschiedenen Laufzeiten bevorzugen und gleichzeitig versuchen, durch Anlagen in Aktien auf sekundärer Basis das langfristige Wachstum zu stärken.

Der Verwalter wird die Nettovermögenswerte gemäß der folgenden strategischen Allokation verteilen:

- Aktien	0 %
- Anleihen	90 %
- Kurzfristige Schuldtitel	10 %

Der Verwalter kann auf taktischer Basis seinen Markterwartungen folgend von der obigen Allokation abweichen.

Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene Vermögenswerte anlegen, doch er darf bis zu 10 % des Nettovermögens des Teilfonds in notleidende Vermögenswerte anlegen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

**Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 90 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds investiert nur in externe Fonds, die unter Artikel 8 oder 9 der Offenlegungsverordnung fallen oder über ein europäisches Nachhaltigkeitslabel verfügen. Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

**Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Aktienindexfutures, Währungsfutures);
- OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).

**ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds 1**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profile Fund Very Defensive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds Zeer Defensief**

Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

**Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

**Risikoprofil**

**Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Gegenparteirisiko
- Derivatrisiko
- Risiko von Gold- und Rohstoffmärkten
- Liquiditätsrisiko
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

**Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

**Anteilskategorien**

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse R	THES	LU0498837904	Ja	Nein	Alle	100 EUR
	AUS	LU1253566050	Ja	Ja		
Klasse A	THES	LU1586378801	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Banque Neufilize OBC oder ihrer verbundenen Unternehmen und zulässige Anleger sind	100 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

**Gebühren und Kosten**

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klasse R	0,45 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse A	0,70 %	-	-	0,18 %	0,05 %

*(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.*

*(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse R	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds 1**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profile Fund Very Defensive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds Zeer Defensief**

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 13. Mai 2010 aufgelegt.

Die „Klasse B“ wurde am 1. März 2016 in „Klasse A-DIS“ umbenannt.

Am 11. März 2016 hat die „Klasse I“ die „Klasse I“ des Eurobonds aufgenommen.

Die „Klasse A-CAP“ und „Klasse A-DIS“ wurden am 26. Februar 2023 in „Klasse R-CAP“ und „Klasse R-DIS“ umbenannt.

Die „Klasse A2-CAP“ wurde am 26. Februar 2023 in „Klasse A-CAP“ umbenannt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

**ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds 2**  
**Kurzbezeichnung AMRO ESG Profile Fund Defensive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds Defensief**

**Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus verschiedenen Anlageklassen, die eine breite Risikostreuung bieten, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

**Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv zwischen verschiedenen Anlageklassen verwaltet, wobei eine vom Anlageausschuss beschlossene strategische und taktische Allokation beachtet wird. Der Fonds erlaubt Engagements in Anlageklassen, geografischen Gebieten, Marktkapitalisierungen und Stilen durch verschiedene Anlageverwalter, die aufgrund ihrer Kompetenzen in einer bestimmten Strategie ausgewählt wurden. Der Auswahlprozess für diese externen Anlageverwalter stützt sich auf eine quantitative Performance- und Risikoanalyse, eine qualitative Bewertung von 5 Bereichen (Managementteam, Researchteam, Philosophie, Prozess- und Risikomanagement) und eine operative Due-Diligence-Prüfung.

Der Teilfonds kann in Anleihen, Aktien, Geldmarktinstrumenten über direkte Anlagen, Finanzderivate sowie Organismen für gemeinsame Anlagen (einschließlich börsennotierter Fonds) investieren. Der Teilfonds kann darüber hinaus über Organismen für gemeinsame Anlagen wie ETF und ETC mit einem maximalen Engagement von 10 % im Rohstoff- und Goldmarkt engagiert sein. Der Schwerpunkt liegt auf einer internationalen Diversifizierung der Anlagen.

Der Teilfonds ist bestrebt, durch eine aktive Verwaltung eines Portfolios aus übertragbaren Wertpapieren bei einem niedrigen Risikoniveau eine Rendite zu erzielen.

Der Verwalter wird versuchen, ein defensives Risikoprofil beizubehalten. Er wird verzinsliche Wertpapiere mit verschiedenen Laufzeiten bevorzugen und gleichzeitig versuchen, durch Anlagen in Aktien auf sekundärer Basis das langfristige Wachstum zu stärken. Anlagen in Schwellenmärkten sind auf 20 % begrenzt.

Der Verwalter wird die Nettovermögenswerte gemäß der folgenden strategischen Allokation verteilen:

- Aktien	20 %
- Anleihen	70 %
- Kurzfristige Schuldtitel	10 %

Der Verwalter kann auf taktischer Basis seinen Markterwartungen folgend von der obigen Allokation abweichen.

Der Teilfonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens über Shanghai-Hong Kong und Shenzhen Stock Connect in chinesische Aktien (A-Aktien) investieren, die auf CNH lauten und an der Hong Kong Stock Exchange notiert sind.

Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene Vermögenswerte anlegen, doch er darf bis zu 10 % des Nettovermögens des Teilfonds in notleidende Vermögenswerte anlegen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

**Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 90 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds investiert nur in externe Fonds, die unter Artikel 8 oder 9 der Offenlegungsverordnung fallen oder über ein europäisches Nachhaltigkeitslabel verfügen. Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

**Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Aktienindexfutures, Währungsfutures),
- OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).



**ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds 2**  
**Kurzbezeichnung AMRO ESG Profile Fund Defensive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds Defensief**

Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

**Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

**Risikoprofil**

**Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Gegenparteirisiko
- Derivatrisiko
- Risiko von Gold- und Rohstoffmärkten
- Liquiditätsrisiko
- Spezifische Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in China
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

**Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

**Anteilskategorien**

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse R	THES	LU0121970122	Ja	Nein	Alle	100 EUR
ABN AMRO Profiefonds A	AUS	LU1253566217	Ja	Ja	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	100 EUR
Klasse A	THES	LU1586379015	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Banque Neuflyze OBC oder ihrer verbundenen Unternehmen und zulässige Anleger sind	100 EUR
Klasse F	THES	LU1586379106	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der Banque Neuflyze OBC und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	THES	LU1253566308	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR
Klasse IH USD	THES	LU1955040164	Ja	Nein		1.000.000 USD

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

**Gebühren und Kosten**

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klasse R	0,60 %	-	-	0,18 %	0,05 %
ABN AMRO Profiefonds A	1,00 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse A	1,00 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse F	0,60 %	-	-	0,18 %	0,01 %
Klasse I, IH USD	0,50 %	-	-	0,15 %	0,01 %

*(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.*

**ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds 2**  
**Kurzbezeichnung AMRO ESG Profile Fund Defensive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds Defensief**

(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse R	5,00 %	1,00 %	1,00 %
ABN AMRO Profiefonds A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse F	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I, IH USD	-	-	-

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR in den Kategorien „Klasse A“, „ABN AMRO Profiefonds A“, „Klasse A2“, „Klasse F“ und „Klasse I“

USD in den Kategorien „Klasse IH USD“

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 11. Juni 2001 mit dem Namen „Defensive Profile“ aufgelegt.

Am 17. Mai 2010 änderte der Teilfonds seinen Namen von „Defensive Profile“ zu „Profile 2“.

Die „Klasse A-CAP“ wurde am 26. Februar 2023 in „Klasse R-CAP“ umbenannt.

Die „Klasse A2-CAP“ wurde am 26. Februar 2023 in „Klasse A-CAP“ umbenannt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

**ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds 3**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profile Fund Moderately Defensive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds Matig Defensief**

**Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus verschiedenen Anlageklassen, die eine breite Risikostreuung bieten, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

**Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv zwischen verschiedenen Anlageklassen verwaltet, wobei eine vom Anlageausschuss beschlossene strategische und taktische Allokation beachtet wird. Der Fonds erlaubt Engagements in Anlageklassen, geografischen Gebieten, Marktkapitalisierungen und Stilen durch verschiedene Anlageverwalter, die aufgrund ihrer Kompetenzen in einer bestimmten Strategie ausgewählt wurden. Der Auswahlprozess für diese externen Anlageverwalter stützt sich auf eine quantitative Performance- und Risikoanalyse, eine qualitative Bewertung von 5 Bereichen (Managementteam, Researchteam, Philosophie, Prozess- und Risikomanagement) und eine operative Due-Diligence-Prüfung.

Der Teilfonds kann in Anleihen, Aktien, Geldmarktinstrumenten über direkte Anlagen, Finanzderivate sowie Organismen für gemeinsame Anlagen (einschließlich börsennotierter Fonds) investieren. Der Teilfonds kann darüber hinaus über Organismen für gemeinsame Anlagen wie ETF und ETC mit einem maximalen Engagement von 10 % im Rohstoff- und Goldmarkt engagiert sein. Der Schwerpunkt liegt auf einer internationalen Diversifizierung der Anlagen.

Der Teilfonds ist bestrebt, durch eine aktive Verwaltung eines Portfolios aus übertragbaren Wertpapieren bei einem moderat niedrigen Risikoniveau Renditen zu erzielen.

Der Verwalter wird versuchen, ein moderates Risikoprofil beizubehalten. Er wird verzinsliche Wertpapiere mit verschiedenen Laufzeiten und Aktien bevorzugen, wobei er ersteren den Vorrang geben wird. Anlagen in Schwellenmärkten sind auf 20 % begrenzt.

Der Verwalter wird die Nettovermögenswerte gemäß der folgenden strategischen Allokation verteilen:

- Aktien	35 %
- Anleihen	55 %
- Kurzfristige Schuldtitel	10 %

Der Verwalter kann auf taktischer Basis seinen Markterwartungen folgend von der obigen Allokation abweichen.

Der Teilfonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens über Shanghai-Hong Kong und Shenzhen Stock Connect in chinesische Aktien (A-Aktien) investieren, die auf CNH lauten und an der Hong Kong Stock Exchange notiert sind.

Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene Vermögenswerte anlegen, doch er darf bis zu 10 % des Nettovermögens des Teilfonds in notleidende Vermögenswerte anlegen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

**Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 90 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds investiert nur in externe Fonds, die unter Artikel 8 oder 9 der Offenlegungsverordnung fallen oder über ein europäisches Nachhaltigkeitslabel verfügen. Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

**Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures,

**ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds 3**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profile Fund Moderately Defensive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds Matig Defensief**

Aktienindexfutures, Währungsfutures);

- OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte). Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

**Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

**Risikoprofil**

**Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Gegenparteiisiko
- Derivatrisiko
- Risiko von Gold- und Rohstoffmärkten
- Liquiditätsrisiko
- Spezifische Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in China
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

**Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

**Anteilskategorien**

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse R	THES	LU0498838035	Ja	Nein	Alle	100 EUR
	AUS	LU1253566480	Ja	Ja		
ABN AMRO Wealth Allocation	THES	LU2281297122	Ja	Nein		
Klasse A	THES	LU1586379288	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Banque Neuflyze OBC oder ihrer verbundenen Unternehmen und zulässige Anleger sind	100 EUR
Klasse I	THES	LU1253566563	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

**Gebühren und Kosten**

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klasse R	0,75 %	-	-	0,18 %	0,05 %
ABN AMRO Wealth Allocation	1,30 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse A	1,30 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse I	0,65 %	-	-	0,15 %	0,01 %

*(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.*

*(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

**ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds 3**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profile Fund Moderately Defensive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds Matig Defensief**

Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse R	5,00 %	1,00 %	1,00 %
ABN AMRO Wealth Allocation	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR.

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 13. Mai 2010 aufgelegt.

Ab dem 1. März 2016 wurde die „Klasse B“ in „Klasse A-DIS“ umbenannt.

Die „Klasse A-CAP“ und „Klasse A-DIS“ wurden am 26. Februar 2023 in „Klasse R-CAP“ und „Klasse R-DIS“ umbenannt.

Die „Klasse A2-CAP“ wurde am 26. Februar 2023 in „Klasse A-CAP“ umbenannt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilinhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

**ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds 4**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profile Fund Moderately Aggressive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds Matig Offensief**

**Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus verschiedenen Anlageklassen, die eine breite Risikostreuung bieten, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

**Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv zwischen verschiedenen Anlageklassen verwaltet, wobei eine vom Anlageausschuss beschlossene strategische und taktische Allokation beachtet wird. Der Fonds erlaubt Engagements in Anlageklassen, geografischen Gebieten, Marktkapitalisierungen und Stilen durch verschiedene Anlageverwalter, die aufgrund ihrer Kompetenzen in einer bestimmten Strategie ausgewählt wurden. Der Auswahlprozess für diese externen Anlageverwalter stützt sich auf eine quantitative Performance- und Risikoanalyse, eine qualitative Bewertung von 5 Bereichen (Managementteam, Researchteam, Philosophie, Prozess- und Risikomanagement) und eine operative Due-Diligence-Prüfung.

Der Teilfonds kann in Anleihen, Aktien, Geldmarktinstrumenten über direkte Anlagen, Finanzderivate sowie Organismen für gemeinsame Anlagen (einschließlich börsennotierter Fonds) investieren. Der Teilfonds kann darüber hinaus über Organismen für gemeinsame Anlagen wie ETF und ETC mit einem maximalen Engagement von 10 % im Rohstoff- und Goldmarkt engagiert sein. Der Schwerpunkt liegt auf einer internationalen Diversifizierung der Anlagen.

Der Teilfonds ist bestrebt, durch eine aktive Verwaltung eines Portfolios aus übertragbaren Wertpapieren bei einem moderat hohen Risikoniveau Renditen zu erzielen.

Der Verwalter wird versuchen, ein mittleres Risikoprofil beizubehalten. Er wird in verzinsliche Wertpapiere mit verschiedenen Laufzeiten sowie in Aktien investieren und im Allgemeinen letztere bevorzugen. Anlagen in Schwellenmärkten sind auf 20 % begrenzt.

Der Verwalter wird die Nettovermögenswerte gemäß der folgenden strategischen Allokation verteilen:

- Aktien	55 %
- Anleihen	35 %
- Kurzfristige Schuldtitel	10 %

Der Verwalter kann auf taktischer Basis seinen Markterwartungen folgend von der obigen Allokation abweichen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 25 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens über Shanghai-Hong Kong und Shenzhen Stock Connect in chinesische Aktien (A-Aktien) investieren, die auf CNH lauten und an der Hong Kong Stock Exchange notiert sind.

Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene Vermögenswerte anlegen, doch er darf bis zu 10 % des Nettovermögens des Teilfonds in notleidende Vermögenswerte anlegen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

**Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 90 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds investiert nur in externe Fonds, die unter Artikel 8 oder 9 der Offenlegungsverordnung fallen oder über ein europäisches Nachhaltigkeitslabel verfügen. Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

**Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures,

**ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds 4**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profile Fund Moderately Aggressive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds Matig Offensief**

Aktienindexfutures, Währungsfutures);

- OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte). Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

**Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

**Risikoprofil**

**Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Gegenpartierisiko
- Derivatrisiko
- Risiko von Gold- und Rohstoffmärkten
- Liquiditätsrisiko
- Spezifische Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in China
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

**Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

**Anteilskategorien**

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse R	THES	LU0121970809	Ja	Nein	Alle	100 EUR
ABN AMRO Profiefonds B	AUS	LU1253566647	Ja	Ja	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	100 EUR
Klasse A	THES	LU1586379445	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Banque Neuflyze OBC oder ihrer verbundenen Unternehmen und zulässige Anleger sind	100 EUR
Klasse I	THES	LU1253566720	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR
Klasse M	THES	LU2570258538	Ja	Nein	Anleger, die Feeder der Teilfonds der Gesellschaft und zugelassene Anleger sind	20.000.000 EUR 20.000.000 USD

(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

**ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds 4**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profile Fund Moderately Aggressive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds Matig Offensief**

**Gebühren und Kosten**

Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungs- gebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klasse R	0,80 %	-	-	0,18 %	0,05 %
ABN AMRO Profiefonds B	1,40 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse A	1,40 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse I	0,70 %	-	-	0,15 %	0,01 %
Klasse M	0,70 %	-	-	0,18 %	0,01 %

(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.

(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse R	5,00 %	1,00 %	1,00 %
ABN AMRO Profiefonds B	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-
Klasse M	-	-	-

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR.

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde mit dem Namen „Diversified Profile“ aufgelegt.

Am 17. Mai 2010 änderte der Teilfonds seinen Namen von „Diversified Profile“ zu „Profile 4“.

Die „Klasse A-CAP“ wurde am 26. Februar 2023 in „Klasse R-CAP“ umbenannt.

Die „Klasse A2-CAP“ wurde am 26. Februar 2023 in „Klasse A-CAP“ umbenannt.



**ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds 4**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profile Fund Moderately Aggressive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds Matig Offensief**

***Besteuerung:***

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

**ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds 5**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profile Fund Aggressive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds Offensief**

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus verschiedenen Anlageklassen, die eine breite Risikostreuung bieten, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv zwischen verschiedenen Anlageklassen verwaltet, wobei eine vom Anlageausschuss beschlossene strategische und taktische Allokation beachtet wird. Der Fonds erlaubt Engagements in Anlageklassen, geografischen Gebieten, Marktkapitalisierungen und Stilen durch verschiedene Anlageverwalter, die aufgrund ihrer Kompetenzen in einer bestimmten Strategie ausgewählt wurden. Der Auswahlprozess für diese externen Anlageverwalter stützt sich auf eine quantitative Performance- und Risikoanalyse, eine qualitative Bewertung von 5 Bereichen (Managementteam, Researchteam, Philosophie, Prozess- und Risikomanagement) und eine operative Due-Diligence-Prüfung.

Der Teilfonds kann in Anleihen, Aktien, Geldmarktinstrumenten über direkte Anlagen, Finanzderivate sowie Organismen für gemeinsame Anlagen (einschließlich börsennotierter Fonds) investieren. Der Teilfonds kann darüber hinaus über Organismen für gemeinsame Anlagen wie ETF und ETC mit einem maximalen Engagement von 10 % im Rohstoff- und Goldmarkt engagiert sein. Der Schwerpunkt liegt auf einer internationalen Diversifizierung der Anlagen.

Der Teilfonds strebt an, die sich bietenden Gelegenheiten zur Wertschöpfung zu nutzen, während er gleichzeitig das Risiko begrenzt und ein Portfolio aus übertragbaren Wertpapieren aktiv verwaltet.

Der Verwalter wird versuchen, ein hohes Risikoprofil beizubehalten. Er wird Aktien bevorzugen und gleichzeitig das Risiko steuern, indem er auf sekundärer Basis in verzinsliche Wertpapiere mit verschiedenen Laufzeiten investiert. Anlagen in Schwellenmärkten sind auf 20 % begrenzt.

Der Verwalter wird die Nettovermögenswerte gemäß der folgenden strategischen Allokation verteilen:

- Aktien	75 %
- Anleihen	15 %
- Kurzfristige Schuldtitel	10 %

Der Verwalter kann auf taktischer Basis seinen Markterwartungen folgend von der obigen Allokation abweichen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 25 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens über Shanghai-Hong Kong und Shenzhen Stock Connect in chinesische Aktien (A-Aktien) investieren, die auf CNH lauten und an der Hong Kong Stock Exchange notiert sind.

Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene Vermögenswerte anlegen, doch er darf bis zu 10 % des Nettovermögens des Teilfonds in notleidende Vermögenswerte anlegen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 90 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds investiert nur in externe Fonds, die unter Artikel 8 oder 9 der Offenlegungsverordnung fallen oder über ein europäisches Nachhaltigkeitslabel verfügen. Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

**ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds 5**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profile Fund Aggressive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds Offensief**

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Aktienindexfutures, Währungsfutures);
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

**Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

**Risikoprofil**

**Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Gegenpartierisiko
- Derivatrisiko
- Risiko von Gold- und Rohstoffmärkten
- Liquiditätsrisiko
- Spezifische Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in China
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

**Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

**Anteilskategorien**

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse R	THES	LU0498838118	Ja	Nein	Alle	100 EUR
	AUS	LU1253566993	Ja	Ja		100 EUR
Klasse A	THES	LU1586379791	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Banque Neuflyze OBC oder ihrer verbundenen Unternehmen und zulässige Anleger sind	100 EUR
Klasse I	THES	LU1253567025	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

**Gebühren und Kosten**

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klasse R	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse A	1,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse I	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %

*(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.*

*(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

**ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds 5**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profile Fund Aggressive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds Offensief**

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse R	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 13. Mai 2010 aufgelegt.

Ab dem 1. März 2016 wurde die „Klasse B“ in „Klasse A-DIS“ umbenannt.

Die „Klasse A-CAP“ und „Klasse A-DIS“ wurden am 26. Februar 2023 in „Klasse R-CAP“ und „Klasse R-DIS“ umbenannt.

Die „Klasse A2-CAP“ wurde am 26. Februar 2023 in „Klasse A-CAP“ umbenannt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

**ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds 6**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profile Fund Very Aggressive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds Zeer Offensief**

**Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus verschiedenen Anlageklassen, die eine breite Risikostreuung bieten, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

**Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv zwischen verschiedenen Anlageklassen verwaltet, wobei eine vom Anlageausschuss beschlossene strategische und taktische Allokation beachtet wird. Der Fonds erlaubt Engagements in Anlageklassen, geografischen Gebieten, Marktkapitalisierungen und Stilen durch verschiedene Anlageverwalter, die aufgrund ihrer Kompetenzen in einer bestimmten Strategie ausgewählt wurden. Der Auswahlprozess für diese externen Anlageverwalter stützt sich auf eine quantitative Performance- und Risikoanalyse, eine qualitative Bewertung von 5 Bereichen (Managementteam, Researchteam, Philosophie, Prozess- und Risikomanagement) und eine operative Due-Diligence-Prüfung.

Der Teilfonds kann in Anleihen, Aktien, Geldmarktinstrumenten über direkte Anlagen, Finanzderivate sowie Organismen für gemeinsame Anlagen (einschließlich börsennotierter Fonds) investieren. Der Teilfonds kann darüber hinaus über Organismen für gemeinsame Anlagen wie ETF und ETC mit einem maximalen Engagement von 10 % im Rohstoff- und Goldmarkt engagiert sein. Der Schwerpunkt liegt auf einer internationalen Diversifizierung der Anlagen.

Der Teilfonds strebt an, die sich bietenden Gelegenheiten zur Wertschöpfung zu nutzen, indem er ein Portfolio aus übertragbaren Wertpapieren aktiv verwaltet.

Der Verwalter wird versuchen, ein aggressives Risikoprofil beizubehalten. Er wird Aktien bevorzugen und gleichzeitig das Risiko steuern, indem er auf sekundärer Basis in verzinsliche Wertpapiere mit verschiedenen Laufzeiten investiert. Anlagen in Schwellenmärkten sind auf 20 % begrenzt.

Der Verwalter wird die Nettovermögenswerte gemäß der folgenden strategischen Allokation verteilen:

- Aktien	90 %
- Anleihen	0 %
- Kurzfristige Schuldtitel	10 %

Der Verwalter kann auf taktischer Basis seinen Markterwartungen folgend von der obigen Allokation abweichen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 51 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens über Shanghai-Hong Kong und Shenzhen Stock Connect in chinesische Aktien (A-Aktien) investieren, die auf CNH lauten und an der Hong Kong Stock Exchange notiert sind.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

**Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 90 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds investiert nur in externe Fonds, die unter Artikel 8 oder 9 der Offenlegungsverordnung fallen oder über ein europäisches Nachhaltigkeitslabel verfügen. Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

**Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Aktienindexfutures, Währungsfutures);
- OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).

**ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds 6**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profile Fund Very Aggressive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds Zeer Offensief**

Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

**Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

**Risikoprofil**

**Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Gegenparteirisiko
- Derivatrisiko
- Risiko von Gold- und Rohstoffmärkten
- Spezifische Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in China
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

**Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

**Anteilskategorien**

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse R	THES	LU0121971286	Ja	Nein	Alle	100 EUR
ABN AMRO Profifonds C	AUS	LU1253567298	Ja	Ja	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	100 EUR
Klasse A	THES	LU1586379957	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der Banque Neufilize OBC oder ihrer verbundenen Unternehmen und zulässige Anleger sind	100 EUR
Klasse I	THES	LU0159601755	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

**Gebühren und Kosten**

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klasse R	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
ABN AMRO Profifonds C	1,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse A	1,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse I	0,75 %	-	-	0,15 %	0,01 %

*(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.*

*(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

**ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds 6**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profile Fund Very Aggressive**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO ESG Profiefonds Zeer Offensief**

Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse R	5,00 %	1,00 %	1,00 %
ABN AMRO Profiefonds C	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

<sup>(1)</sup> Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

<sup>(1)</sup> Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 11. Juni 2001 mit dem Namen „Dynamic Profile“ aufgelegt.

Am 17. Mai 2010 änderte der Teilfonds seinen Namen von „Dynamic Profile“ zu „Profile 6“.

Die „Klasse A-CAP“ wurde am 26. Februar 2023 in „Klasse R-CAP“ umbenannt.

Die „Klasse A2-CAP“ wurde am 26. Februar 2023 in „Klasse A-CAP“ umbenannt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

## **ABN AMRO Funds Comfort Invest II** **Kurzbezeichnung ABN AMRO Comfort Invest II**

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus verschiedenen Anlageklassen, die eine breite Risikostreuung bieten, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds kann in Anleihen, Aktien, Geldmarktinstrumenten über direkte Anlagen, Finanzderivate sowie Organismen für gemeinsame Anlagen (einschließlich börsennotierter Fonds) investieren. Der Schwerpunkt liegt auf einer internationalen Diversifizierung der Anlagen.

Der Teilfonds ist bestrebt, durch eine aktive Verwaltung eines Portfolios aus übertragbaren Wertpapieren bei einem niedrigen Risikoniveau eine Rendite zu erzielen.

Der Verwalter wird versuchen, ein defensives Risikoprofil beizubehalten. Er wird verzinsliche Wertpapiere mit verschiedenen Laufzeiten bevorzugen und gleichzeitig versuchen, durch Anlagen in Aktien auf sekundärer Basis das langfristige Wachstum zu stärken. Anlagen in Schwellenmärkten sind auf 20 % begrenzt.

Der Verwalter wird die Nettovermögenswerte gemäß der folgenden strategischen Allokation verteilen:

- Aktien	20 %
- Anleihen	70 %
- Kurzfristige Schuldtitel	10 %

Der Verwalter kann auf taktischer Basis seinen Markterwartungen folgend von der obigen Allokation abweichen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Aktienindexfutures, Währungsfutures);
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Anlageverwalter**

ABN AMRO Investment Solutions

### **Externer Berater**

ABN AMRO Bank N.V. Niederlassung Belgien

### **Risikoprofil**

#### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Gegenparteirisiko
- Derivatrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### **Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilkategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.



## ABN AMRO Funds Comfort Invest II

### Kurzbezeichnung ABN AMRO Comfort Invest II

#### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	AUS	LU1332699161	Ja	Ja	Alle	100 EUR
Klasse B	AUS	LU1332699245	Ja	Ja	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	AUS	LU2281297395	Ja	Ja	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR

(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

#### Gebühren und Kosten

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klasse A	1,25 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse B	0,95 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse I	0,65 %	-	-	0,18 %	0,01 %

(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.

(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse B	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

#### Zusätzliche Informationen

##### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

##### **Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

##### **Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal drei Bankgeschäftstage nach dem Bewertungstag (T+3) <sup>(1)</sup>

(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

##### **Notierung:**

Keine

##### **Historische Informationen:**

Dieser Teilfonds wurde am 19. Mai 2016 aufgelegt.

<p style="text-align: center;"><b>ABN AMRO Funds Comfort Invest II</b> <b>Kurzbezeichnung ABN AMRO Comfort Invest II</b></p>
--

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

**Dividende:**

Unbeschadet der Rechte und Pflichten der Hauptversammlung wie im Gesetz vom 10. August 1915 und der Satzung vorgesehen wird die Gesellschaft die Ausschüttung der Summe der vereinnahmten Erträge nach Abzug der proportional zugehörigen Vergütung, der Gebühren und Aufwendungen an die Inhaber ausschüttender Anteile beschließen. Für Klassen, die in Belgien und gemäß dem belgischen Einkommensteuergesetzbuch ausgeschüttet werden, sind die ausgeschütteten Erträge mindestens als Erträge zu verstehen, die direkt oder indirekt in Form von Zinsen und (realisierten und nicht realisierten) Kapitalgewinnen (abzüglich Kapitalverluste) aus schuldenbezogenen Vermögenswerten im Sinne von Artikel 19bis §1, (5) des belgischen Einkommensteuergesetzbuchs nach Abzug von Vergütungen, Provisionen und Kosten (das jährliche zu versteuernde belgische Einkommen pro Anteil – „TIS“) entstehen.

# **ABN AMRO Funds Comfort Invest III**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Comfort Invest III**

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus verschiedenen Anlageklassen, die eine breite Risikostreuung bieten, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds kann in Anleihen, Aktien, Geldmarktinstrumenten über direkte Anlagen, Finanzderivate sowie Organismen für gemeinsame Anlagen (einschließlich börsennotierter Fonds) investieren. Der Schwerpunkt liegt auf einer internationalen Diversifizierung der Anlagen.

Der Teilfonds ist bestrebt, durch eine aktive Verwaltung eines Portfolios aus übertragbaren Wertpapieren bei einem moderat niedrigen Risikoniveau Renditen zu erzielen.

Der Verwalter wird versuchen, ein moderates Risikoprofil beizubehalten. Er wird verzinsliche Wertpapiere mit verschiedenen Laufzeiten und Aktien bevorzugen, wobei er den verzinslichen Wertpapieren den Vorrang geben wird. Anlagen in Schwellenmärkten sind auf 20 % begrenzt.

Der Verwalter wird die Nettovermögenswerte gemäß der folgenden strategischen Allokation verteilen:

- Aktien	35 %
- Anleihen	55 %
- Kurzfristige Schuldtitel	10 %

Der Verwalter kann auf taktischer Basis seinen Markterwartungen folgend von der obigen Allokation abweichen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Aktienindexfutures, Währungsfutures);
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Anlageverwalter**

ABN AMRO Investment Solutions

### **Externer Berater**

ABN AMRO Bank N.V. Niederlassung Belgien

### **Risikoprofil**

#### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Gegenparteirisiko
- Derivatrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### **Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

**ABN AMRO Funds Comfort Invest III**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Comfort Invest III**

**Anteilkategorien**

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	AUS	LU1332699591	Ja	Ja	Alle	100 EUR
Klasse B	AUS	LU1332699674	Ja	Ja	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	AUS	LU2281297478	Ja	Ja	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR

(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

**Gebühren und Kosten**

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klasse A	1,25 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse B	0,95 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse I	0,65 %	-	-	0,18 %	0,01 %

(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.

(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse B	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal drei Bankgeschäftstage nach dem Bewertungstag (T+3) <sup>(1)</sup>

(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Dieser Teilfonds wurde in der „Klasse B-EUR“ am 19. Mai 2016 aufgelegt.

<p style="text-align: center;"><b>ABN AMRO Funds Comfort Invest III</b> <b>Kurzbezeichnung ABN AMRO Comfort Invest III</b></p>
--

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

**Dividende:**

Unbeschadet der Rechte und Pflichten der Hauptversammlung wie im Gesetz vom 10. August 1915 und der Satzung vorgesehen wird die Gesellschaft die Ausschüttung der Summe der vereinnahmten Erträge nach Abzug der proportional zugehörigen Vergütung, der Gebühren und Aufwendungen an die Inhaber ausschüttender Anteile beschließen.

Für Klassen, die in Belgien und gemäß dem belgischen Einkommensteuergesetzbuch ausgeschüttet werden, sind die ausgeschütteten Erträge mindestens als Erträge zu verstehen, die direkt oder indirekt in Form von Zinsen und (realisierten und nicht realisierten) Kapitalgewinnen (abzüglich Kapitalverluste) aus schuldenbezogenen Vermögenswerten im Sinne von Artikel 19bis §1, (5) des belgischen Einkommensteuergesetzbuchs nach Abzug von Vergütungen, Provisionen und Kosten (das jährliche zu versteuernde belgische Einkommen pro Anteil – „TIS“) entstehen.

# ABN AMRO Funds Comfort Invest IV

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Comfort Invest IV

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus verschiedenen Anlageklassen, die eine breite Risikostreuung bieten, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds kann in Anleihen, Aktien, Geldmarktinstrumenten über direkte Anlagen, Finanzderivate sowie Organismen für gemeinsame Anlagen (einschließlich börsennotierter Fonds) investieren. Der Schwerpunkt liegt auf einer internationalen Diversifizierung der Anlagen.

Der Teilfonds ist bestrebt, durch eine aktive Verwaltung eines Portfolios aus übertragbaren Wertpapieren bei einem moderat hohen Risikoniveau Renditen zu erzielen.

Der Verwalter wird versuchen, ein mittleres Risikoprofil beizubehalten. Er wird in verzinsliche Wertpapiere mit verschiedenen Laufzeiten sowie in Aktien investieren und im Allgemeinen letztere bevorzugen. Anlagen in Schwellenmärkten sind auf 20 % begrenzt.

Der Verwalter wird die Nettovermögenswerte gemäß der folgenden strategischen Allokation verteilen:

- Aktien	55 %
- Anleihen	35 %
- Kurzfristige Schuldtitel	10 %

Der Verwalter kann auf taktischer Basis seinen Markterwartungen folgend von der obigen Allokation abweichen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Aktienindexfutures, Währungsfutures);
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Anlageverwalter**

ABN AMRO Investment Solutions

### **Externer Berater**

ABN AMRO Bank N.V. Niederlassung Belgien

### **Risikoprofil**

#### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Gegenparteirisiko
- Derivatrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### **Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

**ABN AMRO Funds Comfort Invest IV**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Comfort Invest IV**

**Anteilkategorien**

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	AUS	LU1332699831	Ja	Ja	Alle	100 EUR
Klasse B	AUS	LU1332699914	Ja	Ja	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
Klasse I	AUS	LU2281297551	Ja	Ja	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR

(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

**Gebühren und Kosten**

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klasse A	1,25 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse B	0,95 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse I	0,65 %	-	-	0,18 %	0,01 %

(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.

(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse B	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal drei Bankgeschäftstage nach dem Bewertungstag (T+3) <sup>(1)</sup>

(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

**Notierung:**

Keine

<p style="text-align: center;"><b>ABN AMRO Funds Comfort Invest IV</b> <b>Kurzbezeichnung ABN AMRO Comfort Invest IV</b></p>
--

**Historische Informationen:**

Dieser Teilfonds wurde in der „Klasse B-EUR“ am 19. Mai 2016 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

**Dividende:**

Unbeschadet der Rechte und Pflichten der Hauptversammlung wie im Gesetz vom 10. August 1915 und der Satzung vorgesehen wird die Gesellschaft die Ausschüttung der Summe der vereinnahmten Erträge nach Abzug der proportional zugehörigen Vergütung, der Gebühren und Aufwendungen an die Inhaber ausschüttender Anteile beschließen.

Für Klassen, die in Belgien und gemäß dem belgischen Einkommensteuergesetzbuch ausgeschüttet werden, sind die ausgeschütteten Erträge mindestens als Erträge zu verstehen, die direkt oder indirekt in Form von Zinsen und (realisierten und nicht realisierten) Kapitalgewinnen (abzüglich Kapitalverluste) aus schuldenbezogenen Vermögenswerten im Sinne von Artikel 19bis §1, (5) des belgischen Einkommensteuergesetzbuchs nach Abzug von Vergütungen, Provisionen und Kosten (das jährliche zu versteuernde belgische Einkommen pro Anteil – „TIS“) entstehen.



# **ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Defensief**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Defensief or AAV Beleggingsfonds Zeer Defensief**

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus verschiedenen Anlageklassen, die eine breite Risikostreuung bieten, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds kann in Anleihen, Aktien, Geldmarktinstrumenten über direkte Anlagen, Finanzderivate sowie Organismen für gemeinsame Anlagen (einschließlich börsennotierter Fonds) investieren. Der Teilfonds kann darüber hinaus über Organismen für gemeinsame Anlagen wie ETF und ETC mit einem maximalen Engagement von 10 % im Rohstoffmarkt engagiert sein. Der Schwerpunkt liegt auf einer internationalen Diversifizierung der Anlagen.

Der Teilfonds ist bestrebt, durch eine aktive Verwaltung eines Portfolios aus übertragbaren Wertpapieren bei einem sehr niedrigen Risikoniveau eine Rendite zu erzielen.

Der Verwalter wird versuchen, ein sehr defensives Risikoprofil beizubehalten. Er wird verzinsliche Wertpapiere mit verschiedenen Laufzeiten bevorzugen und gleichzeitig versuchen, durch Anlagen in Aktien auf sekundärer Basis das langfristige Wachstum zu stärken.

Der Verwalter wird die Nettovermögenswerte gemäß der folgenden strategischen Allokation verteilen:

- Aktien: 0 %
- Anleihen: 90 %
- Kurzfristige Schuldtitel: 10 %

Der Verwalter kann auf taktischer Basis seinen Markterwartungen folgend von der obigen Allokation abweichen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Im Rahmen des ESG-Ansatzes der Verwaltungsgesellschaft und im Einklang mit den UN PRI schließt der Teilfonds Direktanlagen in Wertpapieren aus, die von Unternehmen ausgegeben werden, die an sehr umstrittenen Aktivitäten beteiligt sind (z. B. der Produktion von Tabak oder umstrittenen Waffen) und/oder schwerwiegend gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen.

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures),
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Risikoprofil**

#### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Gegenparteiisiko
- Derivatrisiko
- Risiko von Rohstoffmärkten

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### **Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilkategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

**ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Defensief**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Defensief**  
**or AAV Beleggingsfonds Zeer Defensief**

**Anteilkategorien**

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU0752954569	Ja	Nein	Alle	100 EUR

(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

**Gebühren und Kosten**

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klasse A	0,75 %	-	-	0,18 %	0,05 %

(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.

(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr <sup>(2)</sup>	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr <sup>(2)</sup>
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Dieser Teilfonds wurde am 12. März 2012 aufgelegt.

29. Juli 2014: Die Kategorie des Teilfonds änderte sich von „Fund of Funds“ zu „Profile“.

Der frühere Name des Teilfonds war „Verzekeringen Profile 1“.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilinhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# **ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Defensief**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Defensief or AAV Beleggingsfonds Defensief**

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus verschiedenen Anlageklassen, die eine breite Risikostreuung bieten, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds kann in Anleihen, Aktien, Geldmarktinstrumenten über direkte Anlagen, Finanzderivate sowie Organismen für gemeinsame Anlagen (einschließlich börsennotierter Fonds) investieren. Der Teilfonds kann darüber hinaus über Organismen für gemeinsame Anlagen wie ETF und ETC mit einem maximalen Engagement von 10 % im Rohstoffmarkt engagiert sein. Der Schwerpunkt liegt auf einer internationalen Diversifizierung der Anlagen.

Der Teilfonds ist bestrebt, durch eine aktive Verwaltung eines Portfolios aus übertragbaren Wertpapieren bei einem niedrigen Risikoniveau eine Rendite zu erzielen.

Der Verwalter wird versuchen, ein defensives Risikoprofil beizubehalten. Er wird verzinsliche Wertpapiere mit verschiedenen Laufzeiten bevorzugen und gleichzeitig versuchen, durch Anlagen in Aktien auf sekundärer Basis das langfristige Wachstum zu stärken. Anlagen in Schwellenmärkten sind auf 20 % begrenzt.

Der Verwalter wird die Nettovermögenswerte gemäß der folgenden strategischen Allokation verteilen:

- Aktien: 20 %
- Anleihen: 70 %
- Kurzfristige Schuldtitel: 10 %

Der Verwalter kann auf taktischer Basis seinen Markterwartungen folgend von der obigen Allokation abweichen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Im Rahmen des ESG-Ansatzes der Verwaltungsgesellschaft und im Einklang mit den UN PRI schließt der Teilfonds Direktanlagen in Wertpapieren aus, die von Unternehmen ausgegeben werden, die an sehr umstrittenen Aktivitäten beteiligt sind (z. B. der Produktion von Tabak oder umstrittenen Waffen) und/oder schwerwiegend gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen.

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Aktienindexfutures, Währungsfutures);
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Risikoprofil**

#### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Gegenparteiisiko
- Derivatrisiko
- Risiko von Rohstoffmärkten

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

**ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Defensief**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Defensief**  
**or AAV Beleggingsfonds Defensief**

**Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

**Anteilskategorien**

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU0752954643	Ja	Nein	Alle	100 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

**Gebühren und Kosten**

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klasse A	0,75 %	-	-	0,18 %	0,05 %

*(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.*

*(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr <sup>(2)</sup>	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr <sup>(2)</sup>
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Dieser Teilfonds wurde am 12. März 2012 aufgelegt.

29. Juli 2014: Die Kategorie des Teilfonds änderte sich von „Fund of Funds“ zu „Profile“.

Der frühere Name des Teilfonds war „Verzekeringen Profile 2“.

**ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Defensief**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Defensief**  
**or AAV Beleggingsfonds Defensief**

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# **ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Defensief**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Defensief or AAV Beleggingsfonds Matig Defensief**

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus verschiedenen Anlageklassen, die eine breite Risikostreuung bieten, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds kann in Anleihen, Aktien, Geldmarktinstrumenten über direkte Anlagen, Finanzderivate sowie Organismen für gemeinsame Anlagen (einschließlich börsennotierter Fonds) investieren. Der Teilfonds kann darüber hinaus über Organismen für gemeinsame Anlagen wie ETF und ETC mit einem maximalen Engagement von 10 % im Rohstoffmarkt engagiert sein. Der Schwerpunkt liegt auf einer internationalen Diversifizierung der Anlagen.

Der Teilfonds ist bestrebt, durch eine aktive Verwaltung eines Portfolios aus übertragbaren Wertpapieren bei einem moderat niedrigen Risikoniveau Renditen zu erzielen.

Der Verwalter wird versuchen, ein moderates Risikoprofil beizubehalten. Er wird verzinsliche Wertpapiere mit verschiedenen Laufzeiten und Aktien bevorzugen, wobei er ersteren den Vorrang geben wird. Anlagen in Schwellenmärkten sind auf 20 % begrenzt.

Der Verwalter wird die Nettovermögenswerte gemäß der folgenden strategischen Allokation verteilen:

- Aktien: 35 %
- Anleihen: 55 %
- Kurzfristige Schuldtitel: 10 %

Der Verwalter kann auf taktischer Basis seinen Markterwartungen folgend von der obigen Allokation abweichen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Im Rahmen des ESG-Ansatzes der Verwaltungsgesellschaft und im Einklang mit den UN PRI schließt der Teilfonds Direktanlagen in Wertpapieren aus, die von Unternehmen ausgegeben werden, die an sehr umstrittenen Aktivitäten beteiligt sind (z. B. der Produktion von Tabak oder umstrittenen Waffen) und/oder schwerwiegend gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen.

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Aktienindexfutures, Währungsfutures);
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Risikoprofil**

#### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Gegenparteiisiko
- Derivatrisiko
- Risiko von Rohstoffmärkten

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

**ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Defensief**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Defensief**  
**or AAV Beleggingsfonds Matig Defensief**

**Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

**Anteilskategorien**

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU0752954726	Ja	Nein	Alle	100 EUR

(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

**Gebühren und Kosten**

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klasse A	0,75 %	-	-	0,18 %	0,05 %

(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.

(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr <sup>(2)</sup>	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr <sup>(2)</sup>
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Dieser Teilfonds wurde am 12. März 2012 aufgelegt.

29. Juli 2014: Die Kategorie des Teilfonds änderte sich von „Fund of Funds“ zu „Profile“.

Der frühere Name des Teilfonds war „Verzekeringen Profile 3“.

**ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Defensief**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Defensief**  
**or AAV Beleggingsfonds Matig Defensief**

***Besteuerung:***

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.



# **ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Offensief** **Kurzbezeichnung ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Offensief** **oder AAV Beleggingsfonds Matig Offensief**

## **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus verschiedenen Anlageklassen, die eine breite Risikostreuung bieten, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

## **Anlagepolitik**

Der Teilfonds kann in Anleihen, Aktien, Geldmarktinstrumente über direkte Anlagen, Finanzderivate sowie Organismen für gemeinsame Anlagen (einschließlich börsennotierter Fonds) und als Beimischung in Kassainstrumente investieren. Der Teilfonds kann darüber hinaus über Organismen für gemeinsame Anlagen wie ETF und ETC mit einem maximalen Engagement von 10 % im Rohstoffmarkt engagiert sein. Der Schwerpunkt liegt auf einer internationalen Diversifizierung der Anlagen.

Der Teilfonds ist bestrebt, durch eine aktive Verwaltung eines Portfolios aus übertragbaren Wertpapieren bei einem moderat hohen Risikoniveau Renditen zu erzielen.

Der Verwalter wird versuchen, ein mittleres Risikoprofil beizubehalten. Er wird in verzinsliche Wertpapiere mit verschiedenen Laufzeiten sowie in Aktien investieren und im Allgemeinen letztere bevorzugen. Anlagen in Schwellenmärkten sind auf 20 % begrenzt.

Der Verwalter wird die Nettovermögenswerte gemäß der folgenden strategischen Allokation verteilen:

- Aktien: 55 %
- Anleihen: 35 %
- Kurzfristige Schuldtitel: 10 %

Der Verwalter kann auf taktischer Basis seinen Markterwartungen folgend von der obigen Allokation abweichen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

## **Nachhaltige Anlagepolitik**

Im Rahmen des ESG-Ansatzes der Verwaltungsgesellschaft und im Einklang mit den UN PRI schließt der Teilfonds Direktanlagen in Wertpapieren aus, die von Unternehmen ausgegeben werden, die an sehr umstrittenen Aktivitäten beteiligt sind (z. B. der Produktion von Tabak oder umstrittenen Waffen) und/oder schwerwiegend gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen.

## **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Aktienindexfutures, Währungsfutures);
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

## **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

## **Risikoprofil**

### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Gegenparteirisiko
- Derivatrisiko
- Risiko von Rohstoffmärkten

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

**ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Offensief**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Offensief**  
**oder AAV Beleggingsfonds Matig Offensief**

**Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

**Anteilskategorien**

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU0752954999	Ja	Nein	Alle	100 EUR

(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

**Gebühren und Kosten**

Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klasse A	0,75 %	-	-	0,18 %	0,05 %

(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.

(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr <sup>(2)</sup>	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr <sup>(2)</sup>
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Dieser Teilfonds wurde am 12. März 2012 aufgelegt.

29. Juli 2014: Die Kategorie des Teilfonds änderte sich von „Fund of Funds“ zu „Profile“.

Der frühere Name des Teilfonds war „Verzekeringen Profile 4“.

**ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Offensief**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Offensief**  
**oder AAV Beleggingsfonds Matig Offensief**

***Besteuerung:***

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# **ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Offensief**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Offensief oder AAV Beleggingsfonds Offensief**

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus verschiedenen Anlageklassen, die eine breite Risikostreuung bieten, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds kann in Anleihen, Aktien, Geldmarktinstrumenten über direkte Anlagen, Finanzderivate sowie Organismen für gemeinsame Anlagen (einschließlich börsennotierter Fonds) investieren. Der Teilfonds kann darüber hinaus über Organismen für gemeinsame Anlagen wie ETF und ETC mit einem maximalen Engagement von 10 % im Rohstoffmarkt engagiert sein. Der Schwerpunkt liegt auf einer internationalen Diversifizierung der Anlagen.

Der Teilfonds strebt an, die sich bietenden Gelegenheiten zur Wertschöpfung zu nutzen, während er gleichzeitig das Risiko begrenzt und ein Portfolio aus übertragbaren Wertpapieren aktiv verwaltet.

Der Verwalter wird versuchen, ein hohes Risikoprofil beizubehalten. Er wird Aktien bevorzugen und gleichzeitig das Risiko steuern, indem er auf sekundärer Basis in verzinsliche Wertpapiere mit verschiedenen Laufzeiten investiert. Anlagen in Schwellenmärkten sind auf 20 % begrenzt.

Der Verwalter wird die Nettovermögenswerte gemäß der folgenden strategischen Allokation verteilen:

- Aktien: 75 %
- Anleihen: 15 %
- Kurzfristige Schuldtitel: 10 %

Der Verwalter kann auf taktischer Basis seinen Markterwartungen folgend von der obigen Allokation abweichen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Im Rahmen des ESG-Ansatzes der Verwaltungsgesellschaft und im Einklang mit den UN PRI schließt der Teilfonds Direktanlagen in Wertpapieren aus, die von Unternehmen ausgegeben werden, die an sehr umstrittenen Aktivitäten beteiligt sind (z. B. der Produktion von Tabak oder umstrittenen Waffen) und/oder schwerwiegend gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen.

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Aktienindexfutures, Währungsfutures);
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Risikoprofil**

#### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Gegenparteiisiko
- Derivatrisiko
- Risiko von Rohstoffmärkten

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

**ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Offensief**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Offensief**  
**oder AAV Beleggingsfonds Offensief**

**Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilkategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

**Anteilkategorien**

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU0752955020	Ja	Nein	Alle	100 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

**Gebühren und Kosten**

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klasse A	0,75 %	-	-	0,18 %	0,05 %

*(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.*

*(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr <sup>(2)</sup>	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr <sup>(2)</sup>
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Dieser Teilfonds wurde am 12. März 2012 aufgelegt.

29. Juli 2014: Die Kategorie des Teilfonds änderte sich von „Fund of Funds“ zu „Profile“.

Der frühere Name des Teilfonds war „Verzekeringen Profile 5“.

**ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Offensief**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Offensief**  
**oder AAV Beleggingsfonds Offensief**

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# **ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Offensief**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Offensief oder AAV Beleggingsfonds Zeer Offensief**

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus verschiedenen Anlageklassen, die eine breite Risikostreuung bieten, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds kann in Anleihen, Aktien, Geldmarktinstrumenten über direkte Anlagen, Finanzderivate sowie Organismen für gemeinsame Anlagen (einschließlich börsennotierter Fonds) investieren. Der Teilfonds kann darüber hinaus über Organismen für gemeinsame Anlagen wie ETF und ETC mit einem maximalen Engagement von 10 % im Rohstoffmarkt engagiert sein. Der Schwerpunkt liegt auf einer internationalen Diversifizierung der Anlagen.

Der Teilfonds strebt an, die sich bietenden Gelegenheiten zur Wertschöpfung zu nutzen, indem er ein Portfolio aus übertragbaren Wertpapieren aktiv verwaltet.

Der Verwalter wird versuchen, ein aggressives Risikoprofil beizubehalten. Er wird Aktien bevorzugen und gleichzeitig das Risiko steuern, indem er auf sekundärer Basis in verzinsliche Wertpapiere mit verschiedenen Laufzeiten investiert. Anlagen in Schwellenmärkten sind auf 20 % begrenzt.

Der Verwalter wird die Nettovermögenswerte gemäß der folgenden strategischen Allokation verteilen:

- Aktien:	90 %
- Anleihen:	0 %
- Kurzfristige Schuldtitel:	10 %

Der Verwalter kann auf taktischer Basis seinen Markterwartungen folgend von der obigen Allokation abweichen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Im Rahmen des ESG-Ansatzes der Verwaltungsgesellschaft und im Einklang mit den UN PRI schließt der Teilfonds Direktanlagen in Wertpapieren aus, die von Unternehmen ausgegeben werden, die an sehr umstrittenen Aktivitäten beteiligt sind (z. B. der Produktion von Tabak oder umstrittenen Waffen) und/oder schwerwiegend gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen.

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Aktienindexfutures, Währungsfutures);
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Risikoprofil**

#### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Gegenparteirisiko
- Derivatrisiko
- Risiko von Rohstoffmärkten

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

**ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Offensief**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Offensief**  
**oder AAV Beleggingsfonds Zeer Offensief**

**Typisches Anlegerprofil**

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilkategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

**Anteilkategorien**

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU0752955293	Ja	Nein	Alle	100 EUR

(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

**Gebühren und Kosten**

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr <sup>(1)</sup>	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(2)</sup>
Klasse A	0,75 %	-	-	0,18 %	0,05 %

(1) Sofern die Gesellschaft in OGAW und andere OGA desselben Promotors investiert, werden keinem der Teilfonds der Gesellschaft die doppelten Verwaltungsgebühren in Rechnung gestellt.

(2) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr <sup>(2)</sup>	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr <sup>(2)</sup>
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %

(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Dieser Teilfonds wurde am 12. März 2012 aufgelegt.

29. Juli 2014: Die Kategorie des Teilfonds änderte sich von „Fund of Funds“ zu „Profile“.

Der frühere Name des Teilfonds war „Verzekeringen Profile 6“.



**ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Offensief**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Offensief**  
**oder AAV Beleggingsfonds Zeer Offensief**

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds Global Balanced

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Global Balanced

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus verschiedenen Anlageklassen, die eine breite Risikostreuung bieten, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Im Interesse der Diversifizierung werden Anlagen über die gesamte Kurve erfolgen, ohne eine besondere Konzentration auf einen bestimmten Bereich oder Punkt auf der Kurve.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv unter Einbeziehung unterschiedlicher Anlageklassen verwaltet, beispielsweise Aktien, Anleihen, Geldmarktinstrumente über direkte Anlagen, Finanzderivate sowie Organismen für gemeinsame Anlagen (einschließlich börsennotierter Fonds) und Kassainstrumente.

Der Teilfonds ist bestrebt, durch eine aktive Verwaltung eines Portfolios aus übertragbaren Wertpapieren bei einem moderat hohen Risikoniveau Renditen zu erzielen. Der Verwalter wird versuchen, ein mittleres Risikoprofil beizubehalten. Er wird in verzinsliche Wertpapiere mit verschiedenen Laufzeiten und in Aktien investieren.

Für den Teilfonds gelten die folgenden Beschränkungen:

- Mindestallokation in Aktien: 20 %
- Maximale Allokation in Aktien: 75 %
- Maximales Engagement in Hochzins- und Schwellenmarkt-Schuldtiteln: 20 %
- Mindestallokation in Schuldtiteln (Anleihen und Geldmarktinstrumente) 25 %
- Maximale Allokation in Schuldtiteln (Anleihen und Geldmarktinstrumente) 80 %

Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene Vermögenswerte anlegen, doch er darf bis zu 10 % des Nettovermögens des Teilfonds in notleidende Vermögenswerte anlegen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nicht-finanzielle Analyse deckt mindestens 70 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds investiert nur in externe Fonds, die unter Artikel 8 oder 9 der Offenlegungsverordnung fallen oder über ein europäisches Nachhaltigkeitslabel verfügen. Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Aktienindexfutures, Währungsfutures);
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Die Berechnungsmethode des Referenzportfolios finden Sie auf der folgenden Website: [www.msci.com](http://www.msci.com).

## ABN AMRO Funds Global Balanced Kurzbezeichnung ABN AMRO Global Balanced

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### Anlageverwalter

ABN AMRO Investment Solutions

### Externer Berater

ABN AMRO Bank N.V. Niederlassung Belgien

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Gegenparteirisiko
- Derivatrisiko
- Liquiditätsrisiko
- Risiken von Hochzinsanleihen

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilkategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU2229463448	Ja	Nein	Alle	100 EUR
	AUS	LU2229463521		Ja		
Klasse B	THES	LU2229463794	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
	AUS	LU2229463877		Ja		
Klasse I	THES	LU2229463950	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR
	AUS	LU2229464099		Ja		

<sup>(1)</sup> Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse B	1,20 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse I	0,60 %	-	-	0,15 %	0,01 %

<sup>(1)</sup> Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

#### Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse B	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

<sup>(1)</sup> Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

**ABN AMRO Funds Global Balanced**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Global Balanced**

**Zusätzliche Informationen**

**Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

**Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 9. Juli 2021 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# ABN AMRO Funds Flexible Allocation Fund

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Flexible Allocation Fund

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus OGAW-Fonds, die in ein breites Spektrum von übertragbaren Wertpapieren in aller Welt investieren, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird hauptsächlich in OGAW investieren, die ein Engagement in diversifizierten und Multi-Asset-Klassen anstreben (einschließlich Aktien und Schuldtiteln beliebiger Kreditqualität, wandelbaren Wertpapieren, Geldmarktinstrumenten und Währungen). Der Anlageansatz basiert auf einer flexiblen Umsetzung der Allokationsansichten des Anlageverwalters auf Anlageklassen-, Regions- und Sektorebene, ohne besondere Beschränkungen hinsichtlich des Anteils der jeweiligen Anlageklassen.

Allokationen zwischen den Anlageklassen erfolgen im Ermessen des Anlageverwalters, um entweder eine dynamische Allokation zwischen Aktien und Schuldtiteln aufrechtzuerhalten oder um in Abhängigkeit von den Marktbedingungen für Aktien und Schuldinstrumente opportunistische Anlagestrategien umzusetzen.

Der Teilfonds wird sein Nettovermögen in Fonds investieren, die in Übereinstimmung mit mehreren qualitativen und quantitativen Kriterien ausgewählt wurden. Bei der qualitativen Analyse werden die Stabilität und die Stärke des Anlageverwalters sowie sein Anlageprozess und seine Philosophie beurteilt. Der quantitative Auswahlprozess zielt darauf ab, nur Fonds mit einer nachgewiesenen risikoangepassten Performance auszuwählen.

Der Teilfonds hält gewöhnlich durchschnittlich zehn zugrunde liegende Fonds, wobei die Anzahl 15 Fonds nicht übersteigt.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden, und Geldmarktinstrumenten, einschließlich Einlagenzertifikaten und kurzfristiger Einlagen.

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures), zu Anlagezwecken, zur Absicherung und zur effizienten Portfolioverwaltung;
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

Einige der zugrunde liegenden OGAW können im Rahmen ihrer eigenen Anlagepolitik in derivative Finanzinstrumente (einschließlich TRS), Wertpapier-Finanztransaktionen und Schwellenmärkte einschließlich Chinas investieren.

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### **Anlageverwalter**

ABN AMRO Investment Solutions

### **Externer Berater**

ABN AMRO Bank N.V. Niederlassung Belgien

### **Risikoprofil**

#### **Spezifische Risiken des Teilfonds:**

- Risiken, die mit den OGAW verbunden sind, in denen der Teilfonds anlegt
- Risiken in Verbindung mit Aktienmärkten
- Kreditrisiko
- Zinsrisiko
- Währungsrisiko
- Derivatrisiko

## ABN AMRO Funds Flexible Allocation Fund Kurzbezeichnung ABN AMRO Flexible Allocation Fund

- Liquiditätsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilskategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilskategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse A	THES	LU2229464768	Ja	Nein	Alle	100 EUR
	AUS	LU2229464842		Ja		
Klasse B	THES	LU2229464925	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR
	AUS	LU2229465062		Ja		
Klasse I	THES	LU2229465146	Ja	Nein	Institutionelle Anleger, Verwalter, OGA	1.000.000 EUR
	AUS	LU2229465229		Ja		

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

### Gebühren und Kosten

**Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind**

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse A	1,50 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse B	0,85 %	-	-	0,18 %	0,05 %
Klasse I	0,50 %	-	-	0,15 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

**Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind**

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse A	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse B	5,00 %	1,00 %	1,00 %
Klasse I	-	-	-

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

#### **Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

**ABN AMRO Funds Flexible Allocation Fund**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Flexible Allocation Fund**

<b>Zentralisierung der Aufträge</b>	<b>Handelstag der Aufträge</b>	<b>Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW</b>	<b>Abwicklungstag der Aufträge</b>
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal drei Bankgeschäftstage nach dem Bewertungstag (T+3) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wurde am 4. Juni 2021 aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

## **ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities**

### **Kurzbezeichnung ABN AMRO Portfolio Global Equities**

#### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus internationalen Aktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Um die zulässigen Wertpapiere auszuwählen, führt der Verwalter sowohl eine finanzielle als auch eine nicht-finanzielle Analyse unter Verwendung von ESG-Kriterien (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung) in Kombination mit Ausschlussfiltern durch.

#### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und investiert in verschiedene Strategien (aktiv und passiv), die an mehrere Anlageverwalter delegiert sind oder durch Investitionen in Fonds. Der Teilfonds erlaubt eine Aufteilung zwischen verschiedenen Stilen, Marktstrategien und geografischen Gebieten in Aktienmärkten. Der Auswahlprozess für diese externen Anlageverwalter und Fonds stützt sich auf eine qualitative Bewertung von 5 Bereichen (Researchteam, Managementteam, Philosophie, Prozess und Risikomanagement), eine quantitative Analyse (Risiko- und Performanceanalyse) und eine operative Due-Diligence-Prüfung.

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von Unternehmen weltweit einschließlich Schwellenmärkten ausgegeben werden, oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds kann bis zu 30 % seines Nettovermögens in Schwellenmärkte investieren.

Der Teilfonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens über Shanghai-Hong Kong und Shenzhen Stock Connect in chinesische Aktien (A-Aktien) investieren, die auf CNH lauten und an der Hong Kong Stock Exchange notiert sind.

Der Teilfonds kann auch bis zu 10 % seines Nettovermögens in Schuldtitel (wie fest und variabel verzinsliche Anleihen, Geldmarktinstrumente einschließlich Hochzinsanleihen) investieren, insbesondere zum Zwecke der Barmittelverwaltung. Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

#### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 70 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds investiert nur in externe Fonds, die unter Artikel 8 oder 9 der Offenlegungsverordnung fallen oder über ein europäisches Nachhaltigkeitslabel verfügen. Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

#### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Teilfonds kann auf nicht komplexe Positionen auf derivative Finanzinstrumente oder auf derivative Finanzinstrumente zurückgreifen, die nur zum Zwecke der Anlage, Absicherung oder effizienten Portfolioverwaltung verwendet werden.

#### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Referenzportfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.



# ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Portfolio Global Equities

### Anlageverwalter

ABN AMRO Investment Solutions

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Betriebs- und Verwaltrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten
- Spezifische Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in China
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilkategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse G	THES	LU2445655496	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe mit einer spezifischen Gebührenvereinbarung und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse G	1,50 %	-	-	0,18 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

#### Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse G	5,00 %	1,00 %	1,00 %

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

#### **Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

**ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Portfolio Global Equities**

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wird zu einem noch durch den Verwaltungsrat festzulegenden Datum aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# **ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Portfolio Global ESG Equities**

### **Anlageziel**

Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus internationalen Aktien, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error. Um die zulässigen Wertpapiere auszuwählen, führt der Verwalter sowohl eine finanzielle als auch eine nicht-finanzielle Analyse unter Verwendung von ESG-Kriterien (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung) in Kombination mit Ausschlussfiltern durch. Das Portfolio setzt sich aus Emittenten zusammen, die eine führende Stellung im Bereich ESG-Best-Practices aufweisen.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und investiert in verschiedene Strategien, die an mehrere Anlageverwalter delegiert sind oder durch Investitionen in Fonds. Der Teilfonds erlaubt eine Aufteilung zwischen verschiedenen Stilen, Marktstrategien und geografischen Gebieten in Aktienmärkten. Der Auswahlprozess für diese externen Anlageverwalter stützt sich auf eine qualitative Bewertung von 5 Bereichen (Researchteam, Managementteam, Philosophie, Prozess und Risikomanagement), eine quantitative Analyse (Risiko- und Performanceanalyse) und eine operative Due-Diligence-Prüfung.

Der Teilfonds investiert vorwiegend in übertragbare Anteilspapiere wie Aktien, andere Kapitalbeteiligungen wie Genossenschaftsanteile und Partizipationsscheine, die von Unternehmen weltweit einschließlich Schwellenmärkten ausgegeben werden, oder Optionsscheine auf übertragbare Anteilspapiere von solchen Unternehmen.

Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen. Darüber hinaus beträgt die Mindestanlage des Teilfonds in Anteilspapieren 75 % des Nettovermögens des Teilfonds.

Der Teilfonds kann bis zu 30 % seines Nettovermögens in Schwellenmärkte investieren.

Der Teilfonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens über Shanghai-Hong Kong und Shenzhen Stock Connect in chinesische Aktien (A-Aktien) investieren, die auf CNH lauten und an der Hong Kong Stock Exchange notiert sind.

Der Teilfonds kann auch bis zu 10 % seines Nettovermögens in Schuldtitel (wie fest und variabel verzinsliche Anleihen, Geldmarktinstrumente einschließlich Hochzinsanleihen) investieren, insbesondere zum Zwecke der Barmittelverwaltung. Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 90 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds investiert nur in externe Fonds, die unter Artikel 8 oder 9 der Offenlegungsverordnung fallen oder über ein europäisches Nachhaltigkeitslabel verfügen. Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Teilfonds kann auf nicht komplexe Positionen auf derivative Finanzinstrumente oder auf derivative Finanzinstrumente zurückgreifen, die nur zum Zwecke der Anlage, Absicherung oder effizienten Portfolioverwaltung verwendet werden.

### **Verhältnis zum Referenzportfolio**

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Referenzportfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

# ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Portfolio Global ESG Equities

### Anlageverwalter

ABN AMRO Investment Solutions

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Betriebs- und Verwaltrisiko
- Risiko von Schwellenmärkten
- Risiko von Aktien mit niedriger Börsenkapitalisierung, von spezialisierten oder begrenzten Marktsegmenten
- Spezifische Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in China
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben. Institutionelle Anleger qualifizieren sich für eine spezielle Anteilkategorie, wenn ihre Anlagen einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigen.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse G	THES	LU2445655579	Ja	Nein	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe mit einer spezifischen Gebührenvereinbarung und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse G	1,50 %	-	-	0,18 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

#### Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse G	5,00 %	1,00 %	1,00 %

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

#### **Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

**ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Portfolio Global ESG Equities**

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
16:00 Uhr MEZ am Vortag des NIW-Bewertungstags (T-1)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wird zu einem noch durch den Verwaltungsrat festzulegenden Datum aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

# **ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds**

## **Kurzbezeichnung ABN AMRO Portfolio High Quality Bonds**

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus auf Euro lautenden Aggregate Bonds, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und investiert in verschiedene Strategien (aktiv und passiv), die an mehrere Anlageverwalter delegiert sind oder durch Investitionen in Fonds. Der Teilfonds erlaubt eine Aufteilung zwischen verschiedenen Marktstrategien und geografischen Gebieten in Anleihemärkten. Der Auswahlprozess für diese externen Anlageverwalter und Fonds stützt sich auf eine qualitative Bewertung von 5 Bereichen (Researchteam, Managementteam, Philosophie, Prozess und Risikomanagement), eine quantitative Analyse (Risiko- und Performanceanalyse) und eine operative Due-Diligence-Prüfung.

Der Teilfonds investiert vornehmlich in auf Euro lautende Anleihen mit Investment-Grade-Rating und andere festverzinsliche und variabel verzinsliche Wertpapiere. Der Teilfonds kann sich außerdem einer Vielzahl von Instrumenten bedienen, um das Anlageziel des Teilfonds zu erreichen, insbesondere Zinsterminkontrakte, Devisenterminkontrakte (einschließlich nicht lieferbarer Terminkontrakte), Zinsfutures, Anleihenfutures und OTC-Swaps, wie zum Beispiel Zins-Swaps und Credit Default Swaps und Strategien (z. B. Rendite- und Arbitragestrategien durch Anlagen in die vorstehend aufgelisteten Wertpapiere und Derivate). Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen.

Der Teilfonds wird innerhalb der verbleibenden 40 % seines Gesamtnettovermögens und auf konsolidierter Basis alle folgenden Beschränkungen für Anlagen in den nachfolgenden Wertpapieren/Instrumenten respektieren:

- (i) es dürfen maximal 10 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Hochzinsanleihen angelegt werden;
- (ii) es dürfen maximal 25 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Wandelanleihen und sonstigen aktiengebundenen Schuldtiteln angelegt werden;
- (iii) es darf maximal ein Drittel des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Geldmarktinstrumenten, insbesondere Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten einschließlich Einlagenzertifikaten, kurzfristigen Einlagen und Sichtanlagen, angelegt werden;
- (iv) es dürfen maximal 10 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in übertragbaren Anteilspapieren angelegt werden;

Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene Vermögenswerte anlegen, doch er darf bis zu 10 % des Nettovermögens des Teilfonds in notleidende Vermögenswerte anlegen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 70 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds darf investieren:

- bis zu 10 % seines Gesamtnettovermögens in externe passive oder quantitative Fonds und/oder ETF, die gemäß Art. 6 der Offenlegungsverordnung klassifiziert sind, wobei das investierbare Anlageuniversum den internen Regeln der Verwaltungsgesellschaft für Anlagen gemäß Art. 8 oder Art. 9 entspricht.
- bis zu 10 % seines Gesamtnettovermögens in externe passive Fonds und/oder ETF, die Artikel 6 der Offenlegungsverordnung entsprechen. Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures), zu Anlagezwecken, zur Absicherung und zur effizienten Portfolioverwaltung;
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds Kurzbezeichnung ABN AMRO Portfolio High Quality Bonds

### Verhältnis zum Referenzportfolio

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### Anlageverwalter

ABN AMRO Investment Solutions

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Gegenparteirisiko
- Kreditrisiko
- Derivatrisiko
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

### Anteilskategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse G	AUS	LU2445655652	Ja	Ja	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe mit einer spezifischen Gebührenvereinbarung und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR

*(1) Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.*

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse G	0,80 %	-	-	0,18 %	0,01 %

*(1) Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist*

#### Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse G	5,00 %	1,00 %	1,00 %

*(1) Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.*

### Zusätzliche Informationen

#### **Rechnungs- und Referenzwährung:**

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### **Nettoinventarwert (NIW):**

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

<b>ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds</b> <b>Kurzbezeichnung ABN AMRO Portfolio High Quality Bonds</b>
--

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wird zu einem noch durch den Verwaltungsrat festzulegenden Datum aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.



# ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

## Kurzbezeichnung ABN AMRO Portfolio High Quality ESG Bonds

### **Anlageziel**

Erzielung eines mittelfristigen Kapitalzuwachses mithilfe eines diversifizierten und aktiv verwalteten Portfolios aus auf Euro lautenden Aggregate Bonds, ohne besondere Beschränkung in Bezug auf den Tracking Error.

### **Anlagepolitik**

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und investiert in verschiedene Strategien, die an mehrere Anlageverwalter delegiert sind, durch Investitionen in Fonds oder durch direkte Verwaltung durch den Anlageverwalter. Der Teilfonds erlaubt eine Aufteilung zwischen verschiedenen Marktstrategien und geografischen Gebieten in Anleihemärkten. Der Auswahlprozess für diese externen Anlageverwalter und Fonds stützt sich auf eine qualitative Bewertung von 5 Bereichen (Researchteam, Managementteam, Philosophie, Prozess und Risikomanagement), eine quantitative Analyse (Risiko- und Performanceanalyse) und eine operative Due-Diligence-Prüfung.

Der Teilfonds investiert vornehmlich in auf Euro lautende Anleihen mit Investment-Grade-Rating und andere festverzinsliche und variabel verzinsliche Wertpapiere. Der Teilfonds kann sich außerdem einer Vielzahl von Instrumenten bedienen, um das Anlageziel des Teilfonds zu erreichen, insbesondere Zinsterminkontrakte, Devisenterminkontrakte (einschließlich nicht lieferbarer Terminkontrakte), Zinsfutures, Anleihenfutures und OTC-Swaps, wie zum Beispiel Zins-Swaps und Credit Default Swaps und Strategien (z. B. Rendite- und Arbitragestrategien durch Anlagen in die vorstehend aufgelisteten Wertpapiere und Derivate). Die Mindest-Vermögensallokation in solchen Wertpapieren auf konsolidierter Basis (direkte und indirekte Anlagen) wird 60 % des Nettovermögens des Teilfonds betragen.

Der Teilfonds wird innerhalb der verbleibenden 40 % seines Gesamtnettovermögens und auf konsolidierter Basis alle folgenden Beschränkungen für Anlagen in den nachfolgenden Wertpapieren/Instrumenten respektieren:

- (i) es dürfen maximal 10 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Hochzinsanleihen angelegt werden;
- (ii) es dürfen maximal 25 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Wandelanleihen und sonstigen aktiengebundenen Schuldtiteln angelegt werden;
- (iii) es darf maximal ein Drittel des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in Geldmarktinstrumenten, insbesondere Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten einschließlich Einlagenzertifikaten, kurzfristigen Einlagen und Sichtenanlagen, angelegt werden;
- (iv) es dürfen maximal 10 % des Gesamtnettovermögens des Teilfonds in übertragbaren Anteilspapieren angelegt werden;

Der Teilfonds darf nicht in ausgefallene Vermögenswerte anlegen, doch er darf bis zu 10 % des Nettovermögens des Teilfonds in notleidende Vermögenswerte anlegen.

Der Teilfonds kann bis zu 20 % in Sichteinlagen investieren, einschließlich Barmitteln, die auf Kontokorrentkonten bei einer jederzeit zugänglichen Bank gehalten werden.

### **Nachhaltige Anlagepolitik**

Der Teilfonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale und erfüllt die Voraussetzungen eines Anlageprodukts gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, wie in Teil I beschrieben.

Die nichtfinanzielle Analyse deckt mindestens 90 % des Portfolios ab.

Der Teilfonds investiert nur in externe Fonds, die unter Artikel 8 oder 9 der Offenlegungsverordnung fallen oder über ein europäisches Nachhaltigkeitslabel verfügen. Externe Fonds können von der für Direktanlagen geltenden nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft abweichen.

Im Rahmen der nachhaltigen Anlagepolitik der Verwaltungsgesellschaft hält der Teilfonds die für ein Anlageprodukt gemäß Artikel 8 geltenden Ausschlussbestimmungen ein.

**Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und/oder den nachhaltigen Zielen der jeweiligen Teilfonds gemäß SFDR Level II sind in „Anhang 2“ von Teil II des dieses Prospekts zu finden.**

### **Derivative Instrumente**

Der Teilfonds darf durch den Einsatz einer Währungsabsicherung mithilfe derivativer Finanzinstrumente das Risiko von Währungsschwankungen minimieren, wie in Anhang 2 des ausführlichen Prospekts beschrieben.

Der Einsatz derivativer Finanzinstrumente ist beschränkt auf:

- notierte Instrumente, die der Anlagepolitik entsprechen (insbesondere Zinsfutures, Anleihenfutures, Swap-Note-Futures, Währungsfutures), zu Anlagezwecken, zur Absicherung und zur effizienten Portfolioverwaltung;
  - OTC-Instrumente zu Währungsabsicherungszwecken (insbesondere Terminkontrakte und Devisentermingeschäfte).
- Der Einsatz von OTC-Instrumenten zu anderen Zwecken als der Währungsabsicherung ist untersagt (dies gilt insbesondere für OTC-Derivate, CDS- und CDO-Kontrakte).

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds Kurzbezeichnung ABN AMRO Portfolio High Quality ESG Bonds

### Verhältnis zum Referenzportfolio

Dieser Teilfonds wird aktiv verwaltet und im Hinblick auf die Wertentwicklung und das Risikoniveau mit dem in Anhang 2 beschriebenen Referenzportfolio verglichen. Die Bezugnahme auf dieses Referenzportfolio stellt jedoch kein Ziel bzw. keine Beschränkung in Bezug auf die Verwaltung und Zusammensetzung des Portfolios dar und der Teilfonds beschränkt sein Universum nicht auf die Komponenten des Referenzportfolios.

Das Referenzportfolio bewertet oder berücksichtigt seine Bestandteile nicht auf der Grundlage von ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und entspricht daher nicht den vom Teilfonds beworbenen ESG-Merkmalen.

Daher können die Renditen erheblich von der Wertentwicklung des Referenzportfolios abweichen.

### Anlageverwalter

ABN AMRO Investment Solutions

### Risikoprofil

#### Spezifische Risiken des Teilfonds:

- Gegenparteirisiko
- Kreditrisiko
- Derivatrisiko
- Nachhaltigkeitsrisiko

Eine Übersicht über die allgemeinen Risiken finden Sie in Anhang 3 von Teil I des Prospekts.

### Typisches Anlegerprofil

Anteile des Teilfonds sind für Kleinanleger und institutionelle Anleger verfügbar, die das Anlageziel anstreben.

### Anteilkategorien

Kategorie	Klasse	ISIN-Code	Namensanteil	Dividende	Anleger	Mindestbestand <sup>(1)</sup>
Klasse G	THES	LU2445655736	Ja	Ja	Anleger, die Kunden der diskretionären Portfolioverwaltung der ABN AMRO Bank oder verbundener Unternehmen der ABN AMRO Gruppe mit einer spezifischen Gebührenvereinbarung und zugelassene Anleger sind	5.000 EUR

<sup>(1)</sup> Nach Ermessen des Verwaltungsrats kann auf diese Mindestbestände verzichtet werden. In diesem Fall sorgt die Gesellschaft dafür, dass betroffene Anleger gleich behandelt werden.

### Gebühren und Kosten

#### Maximale wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Teilfonds zu zahlen sind

Kategorie	Verwaltungsgebühr	Erfolgsgebühr	Vertriebsgebühr	Sonstige Gebühren	Taxe d'abonnement <sup>(1)</sup>
Klasse G	0,80 %	-	-	0,18 %	0,01 %

<sup>(1)</sup> Darüber hinaus kann die Gesellschaft der Besteuerung für ausländische OGA und/oder sonstigen Regulierungsabgaben in dem Land unterliegen, in dem der Teilfonds für den Vertrieb registriert ist

#### Maximale nicht wiederkehrende Gebühren und Kosten, die vom Anleger an die Platzierungsagenten zu zahlen sind

Kategorie	Zeichnungsgebühr	Umtauschgebühr <sup>(1)</sup>	Rücknahmegebühr
Klasse G	5,00 %	1,00 %	1,00 %

<sup>(1)</sup> Im Falle eines Umtauschs in einen Teilfonds mit einer höheren Zeichnungsgebühr wird unter Umständen die Differenz fällig.

### Zusätzliche Informationen

#### Rechnungs- und Referenzwährung:

EUR, Währung, auf die der Teilfonds lautet.

#### Nettoinventarwert (NIW):

EUR

Jeder volle Bankgeschäftstag in Luxemburg, vorausgesetzt, dass die Finanzmärkte, die einem wesentlichen Anteil (etwa 50 %) der Vermögenswerte des Teilfonds entsprechen, nach dem Tag, der als Grundlage zur Berechnung des vorausgehenden NIW diente, mindestens einen Tag geöffnet waren.

**ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds**  
**Kurzbezeichnung ABN AMRO Portfolio High Quality ESG Bonds**

Er ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, von Vertretungen und in vom Verwaltungsrat bestimmten Zeitungen sowie auf der Website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) verfügbar.

**Bedingungen für Zeichnung, Umtausch und Rücknahme:**

Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge werden zu einem unbekanntem Nettoinventarwert in Übereinstimmung mit den nachfolgend dargelegten Regeln bearbeitet. Die Bearbeitung erfolgt nur an Handelstagen in Luxemburg und die angegebene Uhrzeit ist Luxemburger Ortszeit.

Zentralisierung der Aufträge	Handelstag der Aufträge	Tag der Berechnung und Veröffentlichung des NIW	Abwicklungstag der Aufträge
10:00 Uhr MEZ am NIW-Bewertungstag (T)	Bewertungstag (T)	Tag nach dem Bewertungstag (T+1)	Maximal zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag (T+2) <sup>(1)</sup>

*(1) Wenn der Abwicklungstag ein Währungsfeiertag ist, erfolgt die Abwicklung am nächsten Geschäftstag.*

**Notierung:**

Keine

**Historische Informationen:**

Der Teilfonds wird zu einem noch durch den Verwaltungsrat festzulegenden Datum aufgelegt.

**Besteuerung:**

Potenziellen Anteilhabern wird empfohlen, sich in vollem Umfang über die möglichen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage im Land ihrer Herkunft, ihres gewöhnlichen Aufenthalts oder ihres Wohnsitzes beraten zu lassen.

## ABN AMRO Funds

### Klassifizierung von Teilfonds gemäß der Offenlegungsverordnung und der Taxonomie-Verordnung

Anhang 1 - Offenlegungsverordnung und Taxonomie

Name des Teilfonds	Artikel 6 Offenlegungs- verordnung	Artikel 8 Offenlegungs- verordnung	Artikel 8+ Offenlegungs- verordnung	Artikel 9 Offenlegungs- verordnung	Taxonomie
ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities				X	
ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities			X		
ABN AMRO Funds Aristotle US Equities	X				
ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds			X		
ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds			X		
ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds			X		
ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds			X		
ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities				X	
ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities			X		
ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities			X		
ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds			X		
ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds			X		
ABN AMRO Funds Candriam European ESG Convertibles			X		
ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities			X		
ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities			X		
ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities			X		
ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles			X		
ABN AMRO Funds Candriam Global Dividend Equities	X				
ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds			X		
ABN AMRO Funds Candriam Total Return Global Bonds	X				
ABN AMRO Funds Candriam Total Return Global Equities	X				
ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities				X	
ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities			X		
ABN AMRO Funds Global ESG Equities			X		
ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities			X		
ABN AMRO Funds Insight Euro Aggregate Bonds	X				
ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds			X		
ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged			X		
ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds		X			
ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged		X			
ABN AMRO Fund JPMorgan Asia Pacific ESG Equities			X		
ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities				X	
ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities				X	
ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities		X			
ABN AMRO Funds Numeric Emerging Markets Equities	X				
ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities			X		
ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds				X	
ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds		X			
ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities		X			
ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities			X		
ABN AMRO Funds Pzena European Equities	X				
ABN AMRO Funds Pzena US Equities	X				
ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-related Bonds		X			
ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities		X			
ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds			X		
ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged			X		
ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities			X		
ABN AMRO Funds Fund of Mandates Pacific Equities	X				
ABN AMRO Funds Fund of Mandates Emerging Markets Equities	X				
ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds		X			
ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged		X			
ABN AMRO Funds Fund of Mandates North American Equities	X				
ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds		X			
ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds			X		
ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive					
ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive					
ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive			X		
ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive					
ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive					

**ABN AMRO Funds**  
**Klassifizierung von Teilfonds gemäß der Offenlegungsverordnung und der Taxonomie-Verordnung**

ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive					
ABN AMRO Funds Comfort Invest II					
ABN AMRO Funds Comfort Invest III	X				
ABN AMRO Funds Comfort Invest IV					
ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Defensief					
ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Defensief					
ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Defensief	X				
ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Offensief					
ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Offensief					
ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Offensief					
ABN AMRO Funds Global Balanced		X			
ABN AMRO Funds Flexible Allocation Fund	X				
ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities		X			
ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities			X		
ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds		X			
ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds			X		

**ABN AMRO Funds**  
**Vorvertragliche Anhänge gemäß EU-Verordnung 2022/1288**

Anhang 2 - Vorvertragliche Anhänge in Übereinstimmung mit der EU-Verordnung 2022/1288



## ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Aegon Global impact Equities

**Legal entity identifier:**

549300070E2RYRHKFM90

### Sustainable investment objective

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

**Does this financial product have a sustainable investment objective?**

<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Yes	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="checkbox"/> No
<p><input checked="" type="checkbox"/> It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: 35%</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> </ul> <p><input checked="" type="checkbox"/> It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: 35%</p>	<p><input type="checkbox"/> It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> <li><input type="checkbox"/> with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> <li><input type="checkbox"/> with a social objective</li> </ul> <p><input type="checkbox"/> It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments</p>



**What is the sustainable investment objective of this financial product?**

ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities (“the Sub-Fund”) follows a multi-thematic sustainable investment strategy. The portfolio will be composed of companies exposed to the UN Sustainable Developments Goals (SDGs). To define the sustainable investment universe, a “pass-fail” approach is used using a set of criteria. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the sustainable objectives followed by the Sub-Fund.



## ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Sustainability indicators** measure how the sustainable objectives of this financial product are attained.

### ● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The analysis of certain sustainability indicators is systematically integrated into the investment decision making process. The attainment of the sustainable investment objectives is assessed by investing in securities financing economic activities that substantially contribute to the environmental and/or social objectives mentioned above. To define the sustainable investment universe, a “pass-fail” approach is used using a set of criteria. No other criteria than the one mentioned below are used to define the sustainable investment nature of an investment. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe. To be eligible for the investment universe, the Management Company uses the below criteria:

- Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is assessed by data sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed Science Based Target (SBT)", or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets.
- Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company's estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
- Having a net positive aggregated Overall SDG score. This criterion, sourced from external data provider ISS, assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer's product portfolio on the achievement of sustainability objectives that align with the UN SDGs. For corporate issuers the SDG Solutions Score considers only the most distinct objective scores, i.e., the highest positive and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solution Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.
- Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of the above se criteria or (ii) a different view of the company's impact assessment made by the investment manager and based on other sources. The basis for this differentiated view will be the ‘bottom-up’ qualitative assessment that all investment companies are subjected to before they become eligible for the investment universe.

### ● **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

The "Do No Significant Harm" (DNSH) principle is compiled by taking into account adverse impacts indicators listed in the Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022. The Sub-Fund takes into consideration (for some of them using proxies)

## **ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities**

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

all the adverse impact indicators listed in Table 1 of Annex 1 that are applicable to investee companies.

In addition, the Sub-Fund takes into consideration PAI No. 4 in Table 2 of Annex 2, applicable to investee companies, relating to investments in companies without carbon reduction initiatives. The Sub-Fund also takes into consideration PAI No. 15 of Table 3 of Annex 1, applicable to investee companies, relating to the lack of anti-corruption and anti-bribery policies.

### **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

The Sub-Fund considers and mitigates adverse impacts of its investments on society and environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusions of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator “investing in companies without carbon emission reduction initiatives” (i.e. PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the optional indicator “lack of anti-corruption and anti-bribery policies” (i.e. PAI 15) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

### **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

The Sub-Fund's sustainable investments are aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights, including the principles and rights set forth in the 8 “fundamental” conventions identified in the International Labor Organization's Declaration on Fundamental Principles (covering subjects that were considered to be fundamental principles and rights at work, e.g. freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining, the elimination of all forms of forced or compulsory labour, the effective abolition of child labour, and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation) and Rights at Work and the International Bill of Human Rights. Alignment is ensured through exclusions.

## ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers and mitigates adverse impacts of its investments on society and environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusion of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 in portfolio management decisions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator “investing in companies without carbon emission reduction initiatives” (i.e. PAI 4) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the optional indicator “lack of anti-corruption and anti-bribery policies” (i.e. PAI 15) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- ☐ No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund considers ESG analysis at every stage of the investment process when: screening the initial universe, selecting the eligible companies, constructing the portfolio, deciding to sell a company and replace it by another company, engaging actively with a company to maximise the positive impact trajectory.

The process of selecting companies starts with applying quantitative screens on a global universe by using the external ESG data providers Sustainalytics and ISS. The first screen is performed relying on the ESG data from Sustainalytics and consist of i.) applying activity-based and norm-based exclusions and of ii.) ranking companies in their sub-industry peer groups according to their ESG risk score. Only companies that pass the exclusions tests and that are ranking within the first 50% in their sub-industry peer group are eligible. The second quantitative screen will rely on the overall SDG solutions score of the external data provider ISS ; these overall scores are composed of 15 sub-scores (tackling environmental and/or social issues) assessing in what proportion the products and solutions provided by the companies are likely positively or negatively addressing one or several of the 17 UN-Sustainable Development Goals.

Subsequentl to these quantitative screenings, a qualitative assessment of the company’s impact is performed. This step enables the investment strategy to capture aspects that the quantitative analysis might overlook. The qualitative assessment allows for a more nuanced opinion on the company's policies, future plans, and of the potential impact of corporate practices or operations on the UN SDGs. It also ensures that the universe consists only of companies in which the Management Company has a high level of satisfaction that they are aligned with the fund’s sustainable investment objective. As part of the qualitative analysis, all companies are assigned one of 5 categories based on the extent to which they are involved or finance economic activities that contribute to the UN SDGs: Leader, Improver, Influencer, Neutral and Ineligible (with all but the later big determined as ‘eligible’ as per

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

the investment strategy). The qualitative assessment may also lead to the initiation of engagement with the company.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies non-compliant with SFDR Sustainable Investments mandatory norms and conventions	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Sustainable investment eligibility criteria (the below criteria may not be cumulative):
  - Having a net positive aggregated Overall SDG score. This criterion, sourced from external data provider ISS, assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer's product portfolio on the achievement of sustainability objectives that align with the UN SDGs. For

## ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

corporate issuers the SDG Solutions Score considers only the most distinct objective scores, i.e., the highest positive and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solutions Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.

- Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is assessed by data sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed Science Based Target (SBT)", or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets.
- Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company's estimated future carbon emissions are no longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
- Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of the above criteria or (ii) a different view of the company's impact assessment made by the investment manager and based on other sources. The basis for this differentiated view will be the 'bottom-up' qualitative assessment that all investment companies are subjected to before they become eligible for the investment universe.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its "Good Governance Policy", the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS "exclusion policy" are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry-established norms, as set forth below:

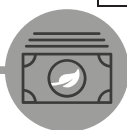
**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.

## ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.



### What is the asset allocation and the minimum share of sustainable investments?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the sustainable investment process in place, hence in investments that are defined as sustainable (#1 Sustainable). The proprietary sustainable analysis covers 100% of the “#1 Sustainable” investments.” #1 Sustainable” investments include a minimum of 35% assets with environmental objectives and 35% with social objectives. Investments with environmental objectives are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy.

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Not Sustainable). “#2 Not Sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for hedging purposes. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.

**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

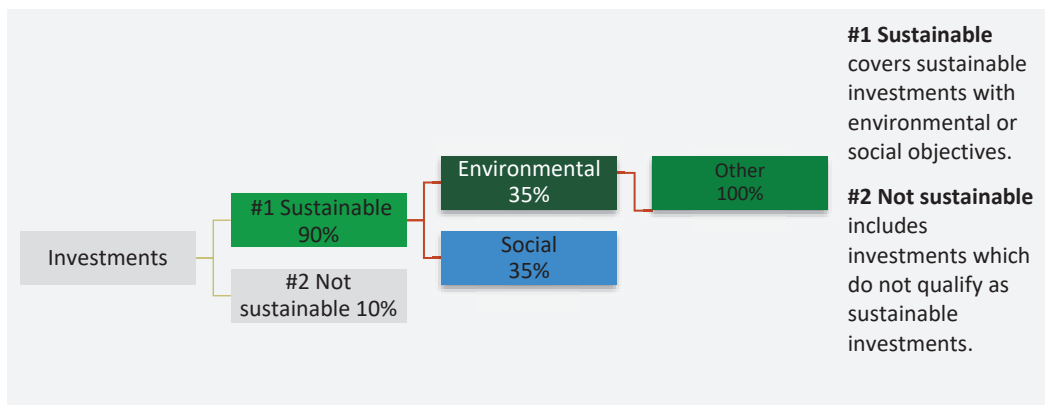
## ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.



**#1 Sustainable** covers sustainable investments with environmental or social objectives.

**#2 Not sustainable** includes investments which do not qualify as sustainable investments.

● **How does the use of derivatives attain the sustainable investment objective?**

Not Applicable



**To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

The Sub-Fund's sustainable investments with an environmental objective are not aligned with the EU taxonomy (i.e. 0%) as the investments with an environmental objective are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU taxonomy.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

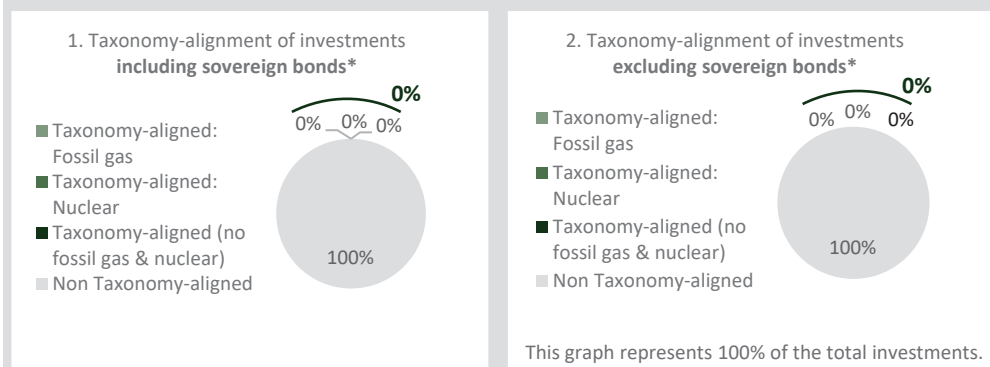
- Yes:
  - In fossil gas
  - In nuclear energy
- No

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy is 100%. The Sub-Fund commits to make a minimum of 35% sustainable investments with an environmental objective not aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund commits to make a 35% minimum share of sustainable investments with a social objective.



### What investments are included under “#2 Not sustainable”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Not sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for hedging and efficient management portfolio purposes. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



## ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Is a specific index designated as a reference benchmark to meet the sustainable investment objective?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- **How does the reference benchmark take into account sustainability factors in a way that is continuously aligned with the sustainable investment objective?**  
Not Applicable
- **How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?**  
Not Applicable
- **How does the designated index differ from a relevant broad market index?**  
Not Applicable
- **Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?**  
Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- **ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:**  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- **Documents of the Sub-Fund:**  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

## ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

**Legal entity identifier:**

549300Y65XF78A4B5R38

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

### Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate

## ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

social responsibility policy as well as its overall sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are flexible in ESG best-practice.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment, and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

## ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Scope 1 GHG Emissions - Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions - Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

— ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

— ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

## ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding **(i)** United Nations Global Compact non-compliant companies and **(ii)** controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund invests primarily in companies domiciled or exercising a major part of their economic activity in Europe. The External Investment Manager's investment process is based on bottom-up fundamental stock selection. The Fund focuses on buying viable business models that are trading at a discount to their intrinsic value. ESG analysis is an essential pillar of the External Investment Manager's fundamental assessment of a business model. More specifically, in terms of ESG analysis, the External Investment Manager relies on ESG ratings and qualitative inputs provided by the internal ESG analysis team.

ESG is fully integrated into the stock selection process as part of the bottom-up analysis. The outcome of the ESG materiality assessment may impact the External Investment Manager's assessment in different ways. Structural ESG deterioration could potentially reduce long-term top line growth assumptions and impair the External Investment Manager's sustainable earnings power assessment and therefore reduce the company's intrinsic value. Should the External Investment Manager determine that a period of ESG weakness is temporary in nature, the External Investment Manager would be comfortable to invest in the company, however it would typically account for this weakness by (i) requiring a higher margin of safety (ii) increasing liabilities.

The External Investment Manager in-house ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. The rating is a relative rating, reflecting the ESG performance of a company compared to the average performance of its industry. To assign an ESG rating to all the companies in its universe, the External Investment Manager has developed a proprietary ESG rating methodology combining a quantitative and qualitative analysis. Using a Best-in-Class approach the ESG analysts oversee defining the most relevant quantitative ESG external data criteria for each sector and weighting them by sector. The purpose is to identify the most relevant ESG key risks and opportunities by sector.

In addition to ESG ratings, the ESG analysts integrate qualitative inputs by performing an in-depth analysis on selected issuers. The coverage of a company is triggered by (i) the requests of portfolio managers to cover non-rated issuers (ii) the level of exposure of the External Investment Manager to the investee companies (iii) the annual Engagement

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

campaign (iv) the issuers with a particularly weak ESG rating for a given criterion (v) the quarterly controversies screening.

Engagement forms an integral part to the strategy. The External Investment Manager carries out thematic and ongoing engagements. Thematic engagement revolves around themes common to several sectors, aiming to understand existing practices, promote best practice, recommend improvements, and measure progress. Ongoing engagement can cover multiple issues or themes. Specific reasons for ongoing engagement include (i) engagement around specific challenges, sustainability risks or opportunities, either for the company or its sector as a whole (ii) engagement around controversies, responding to a failure properly to manage a sustainability risk (iii) engagement with leaders, to encourage them to continue to pursue leading practice (iv) engagement with improvers, working closely with companies that wish to learn how to enhance their approach (v) engagement with laggards, working with those companies with poor performance on one or more ESG criteria (vi) engagement around the External Investment Manager policies prior to possible divestment for ESG reasons (vii) pre-AGM dialogue.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%

## ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%
Government Exclusions based on Norms and Policies	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes
Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Companies that do not pass the external investment manager’s ESG suitability analysis. The External Investment Manager takes into account the 80% highest rated benchmark index universe, thus reducing the investment universe by 20% based on ESG criteria for the highest ESG category (or the highest rating).

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

## ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels )	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

The External Investment Manager ESG scoring is based on a proprietary ESG analysis framework, which accounts for general and sector-specific criteria, including governance criteria. In the Governance dimension, the External Investment Manager assesses an issuer’s ability to ensure an effective corporate governance framework that guarantees it will meet its long-term objectives. The governance sub-criteria considered are board structure, audit and control, remuneration, shareholders’ rights, ethics, tax practices and ESG strategy. The External Investment Manager ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. G-rated companies are excluded from the investment universe.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

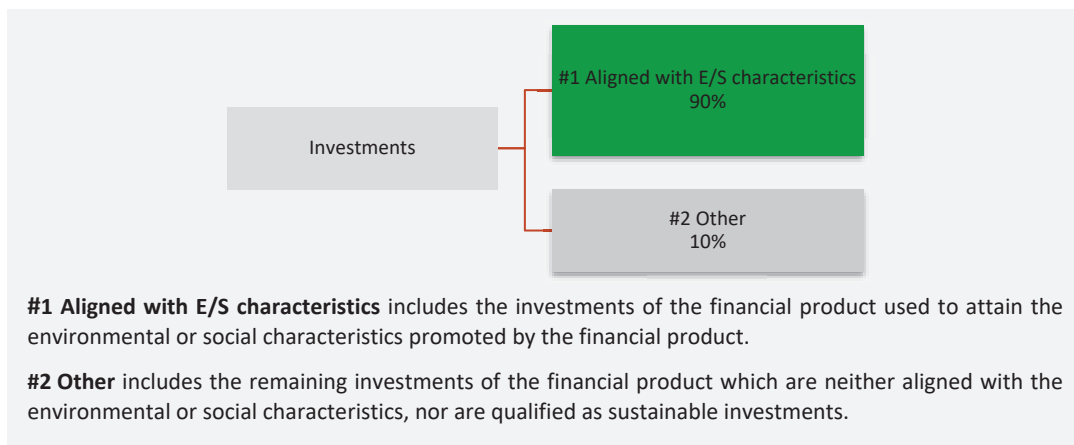


## ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

Yes:

In fossil gas     In nuclear energy

No

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus. *There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.*



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

## ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?**

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***  
Not Applicable
- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***  
Not Applicable
- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***  
Not Applicable
- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***  
Not Applicable



**Where can I find more product specific information online?**

*More product-specific information can be found on the websites:*

- *ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:*  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abnamro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- *Documents of the Sub-Fund:*  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

## ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

**Legal entity identifier:**

549300MOSLE8705NBI56

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

## ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.

## ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

— *How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?*

Not Applicable

— *How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:*

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

## ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund aims to provide medium term capital growth with a diversified and actively managed portfolio of sustainable emerging market bonds. The Sub-Fund is actively managed through a top-down and bottom-up research with a strong focus on ESG research. The portfolio will be composed of issuers that are either leading in ESG practices or attractive due to their progression in ESG.

For emerging market corporate debt, an ESG review is included in credit underwriting process of each investment. Through a proprietary research, the external investment manager provides all companies held in portfolio with an internal quantitative rating. All such analysis then ultimately feeds into the analyst view of the credit, and allows them to conduct the broadest possible analysis of each underlying credit. An ESG score between 1 (Excellent) to 5 (Unfavourable) is assigned in the credit analysis and portfolio management system to the issuers that captures both the current ESG performance relative to peers as well as the outlook, which rates the momentum of the entity's ESG efforts (outlook: 1, improving; 2, stable and 3, deteriorating); the final score will result in two components: ESG score/outlook score.

The approach to country analysis begins with an analysis of high-level ESG factors; governance, institutions, transparency, policy framework and credibility. As key determinants of sovereigns' financial performance, fiscal and external deficits, public and external debt, and external liquidity, and the sustainability, or lack thereof, of that performance. The external investment manager then incorporates a mix of quantitative and qualitative analysis, leading to an overall assessment of ESG factors in the context of a country's policy framework and decision-making. Credibility and quality of a country's policy framework are pivotal to investment decisions, as the external investment manager believes they are key to determining a country's ability to withstand uncertainty and shocks, whether external, internal, political or economic, as well as environmental challenges. The analysis will result in a ESG score between 1 (Excellent) to 5 (Unfavourable) with a trend additional score (trend: 1, improving; 2, stable and 3, deteriorating); the final score will result in two components: ESG score/trend score. The external investment manager will not consider scores over 4/2 eligible for investment; the external investment manager will then perform further analysis to consider the valuation of these issuers and the appropriate time to purchase in consideration of the Fund's financial objective.

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%
Government Exclusions based on Norms and Policies	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes
Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).



## ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. As part of its ESG inclusion screening and based on its own methodology and scoring systems, the External Investment Manager will consider for investment only issuers, on corporate and Sovereign sides, with a minimum overall ESG score of 4 and a minimum trend score of 2.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human

## ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

			rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

The external investment manager’s ESG methodology incorporates an assessment of a company’s governance practices. In summary, companies are assessed against a range of factors, which include but are not limited to sound management structures, employee relations, remuneration of staff, tax compliance, board diversity and credibility of auditing arrangements.

The good governance requirements outlined in the SFDR regulation are only applicable to investments in companies. Nonetheless, the external investment manager has in place a good governance methodology when it comes to consider emerging markets state-owned companies, sovereign agencies and sovereigns.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

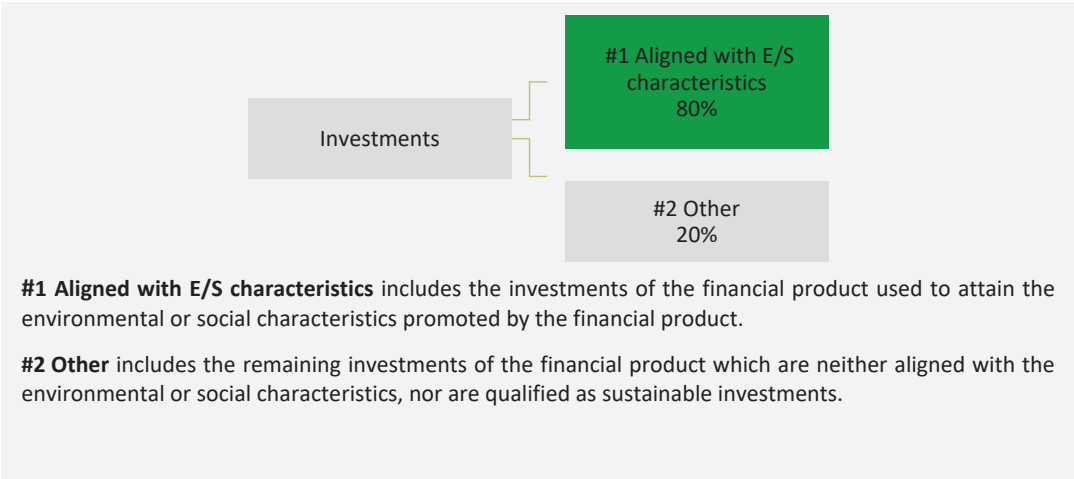
**Asset allocation**  
describes the share  
of investments in  
specific assets.

## ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>2</sup>?**

Yes:

In fossil gas     In nuclear energy

No

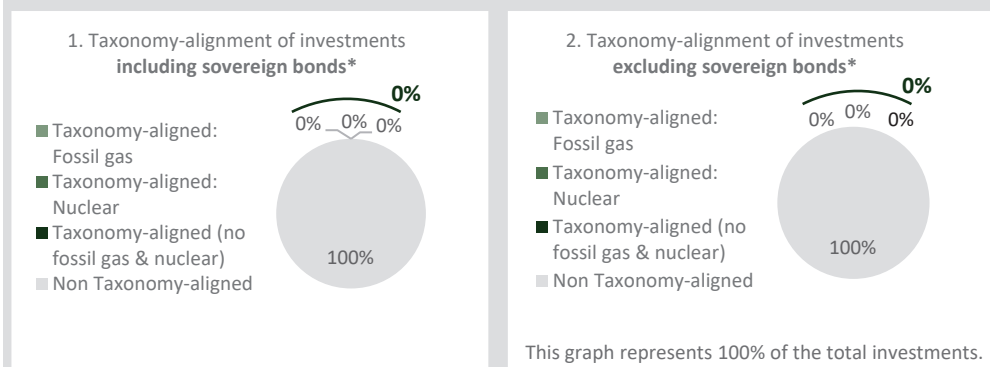
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

<sup>2</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

## ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?**

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



**Where can I find more product specific information online?**

*More product-specific information can be found on the websites:*

- *ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:*  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- *Documents of the Sub-Fund:*  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

**Legal entity identifier:**

549300S3NCDG06TD1P08

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Manager must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

## ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.

## ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



## ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria.

The External Investment Manager uses a proprietary ESG framework combining ESG negative and positive selection. The ESG assessment and selection process of the External Investment Manager differs depending on whether the investment is in Sovereign or in companies.

Regarding investments in Sovereigns: the External Investment Manager makes use of its proprietary ESG methodology to assess the ESG scores of the sovereigns composing its proprietary Sovereign sustainability index (covering to date 99 sovereign issuers). The ESG performance is based primarily of World Bank indicators. The External investment Manager will consider for investing in the Sub-Fund, Sovereigns that are in the top 75% of the Sovereign sustainability index ("best-in-universe approach") and that pass the exclusion policy of the Management Company. Regarding investments in companies: the External Investment Manager will mainly utilizes ESG data sourced from external providers for selecting the eligible companies. The External investment Manager will consider for investing in the Sub-Fund corporates that are ranked in the highest five ranking categories of the seven ranking categories currently utilized by the External Investment Manager's external ESG provider.

The External Investment Manager also uses external ESG research providers together with internal research for ongoing efforts to integrate additional ESG information into the investment process. The External Investment Manager conducts additional due diligence, which is combined with other inputs to create a mosaic of information referenced in investment decision making. These include, ESG-related specialist media and databases (e.g. Climate Disclosure Project), proxy research, and analysis published by investment banks, specialist consultancies and non-governmental organisations.

Regarding the portfolio construction, the External Investment Manager uses a two-step process which involves a top-down view being formed by its Investment Strategy Group

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

and relative value discussions leading to portfolio construction decisions made by its European Fixed Income team.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%
Government Exclusions based on Norms and Policies	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes
Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

## ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the External Investment Manager ESG suitability analysis in terms of ESG score. The External Investment Manager will only consider for inclusion in the portfolio: (i) Sovereigns that are in the top 75% of the Sovereign universe (as defined by the External Internal Manager) and (ii) corporates that are ranked in the highest five ranking categories of the seven ranking categories currently utilized by the External Investment Manager'ESG provider.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.

## ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

The External investment Manager assesses good governance practices of the investee companies by combining proprietary insights with data from external ESG research providers to initially identify issuers which may not have satisfactory governance practices in relation to key performance indicators (KPIs) related to sound management structure, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

The good governance requirements outlined in the SFDR regulation are only applicable to investments in companies.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

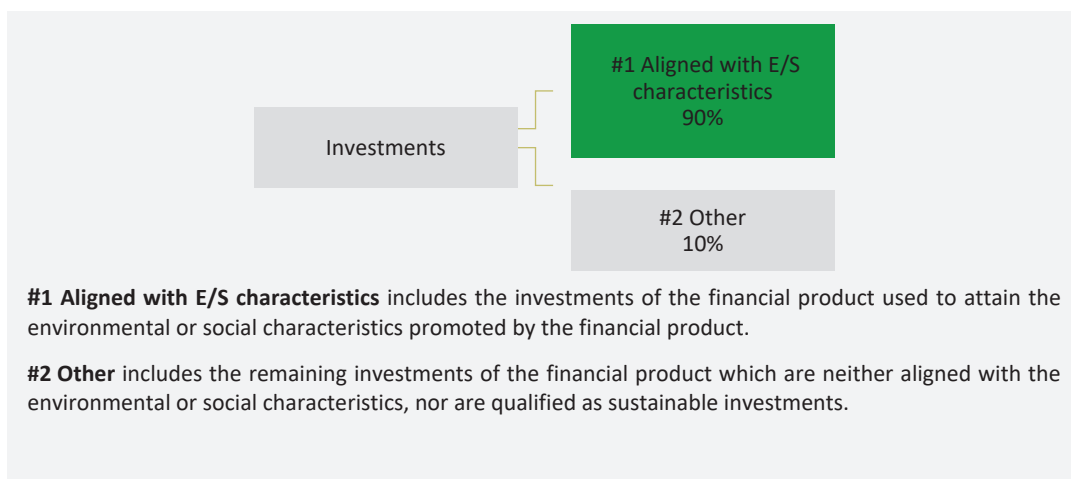
**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

## ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

- Yes:
- In fossil gas  In nuclear energy
- No

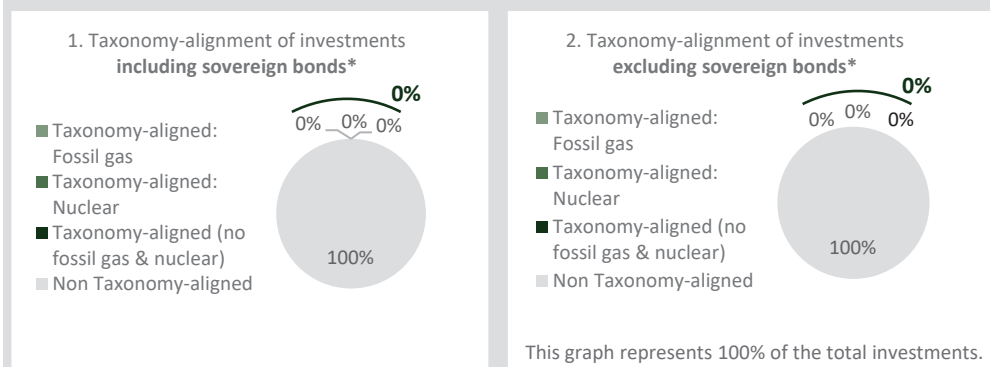
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

## ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

**Legal entity identifier:**

549300NY79BM2BZDX373

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds (the "Sub-Fund"). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the "Management Company") ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall



## ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.

## ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

## ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

The External Investment Manager adopts an approach to proprietary macro, credit and ESG research to help identify both long and short opportunities across a universe of alpha sources.

Conviction score is driven by assessment of fundamentals, valuation, technicals and ESG. The External Investment Manager conducts ESG analysis on corporate and sovereign issuers as part of the initial stage of the investment process which comprises of fundamental and ESG research, using its own proprietary issuer ESG evaluation framework. The analysis can be either a preliminary or detailed ESG evaluation to ensure the issuer is eligible for investment. The evaluation results in two complementary ESG metrics: a fundamental ESG Risk Rating (i.e. indicates a view on the quality of management of material ESG risks/opportunities faced by the issuer), and an investment ESG Score (i.e. reflects an investment view on the extent to which ESG factors are considered relevant/material to valuations).

The External Investment Manager will exclude from investments issuers not meeting the minimum threshold of ESG risk rating resulting from the internal analysis (have a 'very high' Fundamental ESG Risk rating), and will additionally apply restrictions on issuers which have an overall ESG score below a set threshold (<5/10 with 0 being the worst and 10 being the best) using the assessment of third party ESG information providers utilized by the External Investment Manager.

The External Investment Manager may engage with issuers of interest to further develop insights, and/or to promote change either to mitigate investment risks or protect the ESG characteristics. Insights gained from this process further inform on investment views and decisions and can potentially result in changes to the assigned ESG metrics.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences)

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%
Government Exclusions based on Norms and Policies	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes
Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. As part of the ESG inclusion selection process of the External investment Manager, are eligible for investment companies that have an overall ESG score above a set threshold (>5/10) using the assessment of third party ESG information providers utilized by the External Investment Manager.

## ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

- ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

## ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The External Investment Manager's ESG suitability analysis methodology incorporates an assessment of a company's governance practices. As part of the external investment manager's proprietary ESG evaluation framework, any issuer deemed to have 'very high' ESG risks on the governance pillar is automatically assigned a 'very high' Fundamental ESG (Risk) Rating overall, and consequently systematically excluded from investment.

The good governance requirements outlined in the SFDR regulation are only applicable to investments in companies. Nonetheless, the External Investment Manager has in place a good governance methodology when it comes to consider state-owned companies, sovereign agencies and sovereigns.

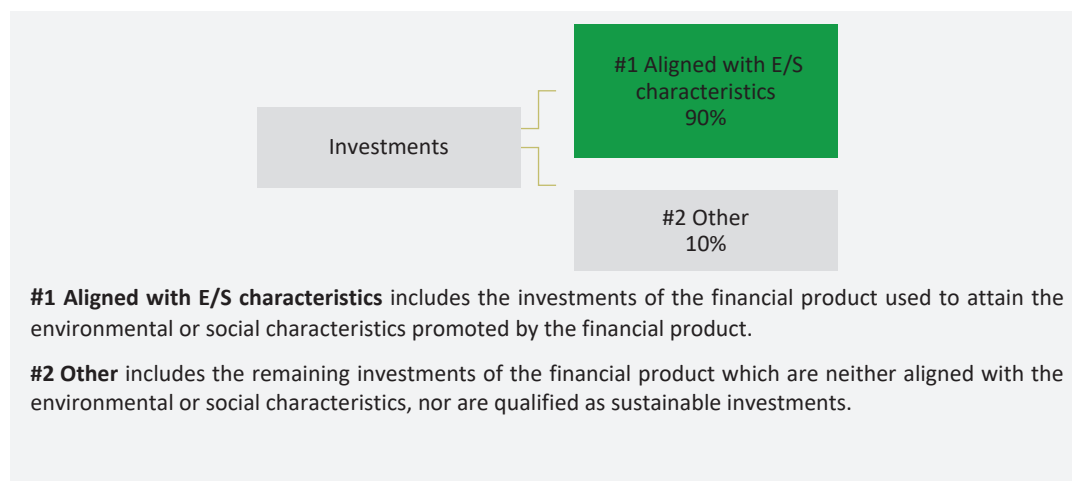


**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as "eligible" as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics)).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). "#2 Other" includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



### ● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



### **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

## ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

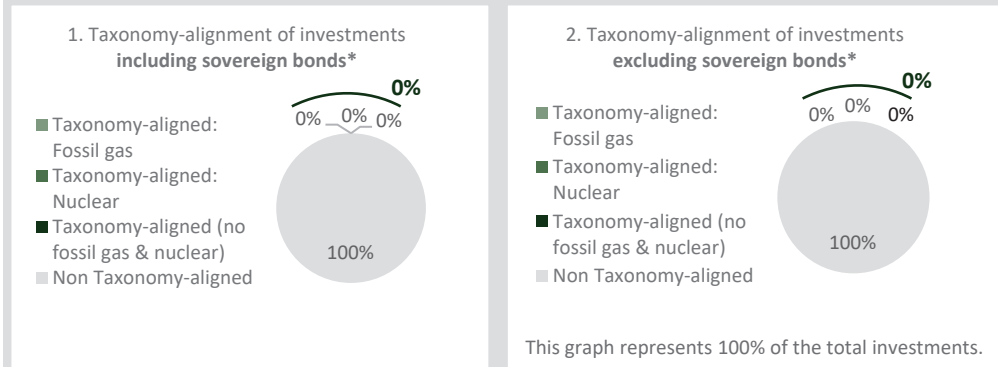
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

- Yes:
- In fossil gas     In nuclear energy
- No

*The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



**What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable



**What is the minimum share of socially sustainable investments?**

Not Applicable

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.



## ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

**Legal entity identifier:**

636700DNLWJGXU182K34

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds (the "Sub-Fund"). The External Investment Manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the "Management Company") ESG responsibility criteria. The External Investment Manager must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

## ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions - Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.

## ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

## ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

The External Investment Manager adopts an approach to proprietary macro, credit and ESG research to help identify both long and short opportunities across a universe of alpha sources. Conviction score is driven by assessment of fundamentals, valuation, technicals and ESG. The External Investment Manager conducts ESG analysis on in-scope sovereign issuers (and related) as part of the initial stage of the investment process which comprises of fundamental and ESG research, using its own proprietary issuer ESG evaluation framework. The analysis can be either a preliminary or detailed ESG evaluation to ensure the issuer is eligible for investment.

The evaluation results in two complementary ESG metrics:

- Fundamental ESG Risk Rating : indicates a view on the quality of management of material ESG risks/opportunities faced by the issuer (resulting from the risk exposure it faces and the quality of mitigation efforts). There can only be one Fundamental ESG Rating per issuer across the External Investment Manager. The Fundamental ESG (Risk) Rating ranges from 'Very Low ESG risks' to 'Very High ESG risks'.
- Investment ESG Score which reflects the investment view on the extent to which the ESG factors are considered relevant to valuations, as well as the nature of that materiality (i.e. positive, negative, neutral). This is a security/instrument specific assessment and as such there may be multiple Investment ESG Scores for a single issuer depending on the held security. The Indicative Investment ESG Score ranges from -3 (very high ESG investment-related risks) to +3 (very high investment opportunities because of ESG considerations).

Complementing the External Investment Manager ESG integration approach is engagement, which describes the interaction between investors and issuers and other key stakeholders. The External Investment Manager believes that providers of debt do have a role in engaging with issuers and other relevant stakeholders on matters with the potential to impact investment returns, which may include ESG-related ones. In general the External Investment Manager may engage with issuers on ESG factors if these are deemed to represent ESG risks. Whilst issuers are usually the primary focus of engagement for corporate investment strategies, engagement with non-issuer stakeholders (such as

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

politicians, financial institutions, industry associations, and/or specialist political advisers / consultants) are more of a common feature for sovereign debt investing.

The External Investment Manager may engage with issuers of interest to further develop insights, and/or to promote change either to mitigate investment risks or protect the ESG characteristics. Insights gained from this process further inform on investment views and decisions and can potentially result in changes to the assigned ESG metrics.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

● ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding ESG requirements result from (i) ESG Exclusions / Screening; (ii) Norms-Based Screening; and (iii) ESG Integration. A number of sources provided by the Management Company and the External Investment Manager apply to the Sub-Fund as follows:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table, meaning that investment should pass the following test:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>5%

## ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Government Exclusions based on Norms and Policies	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes
Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Exclusion of the companies that do not pass the External Investment Manager ESG suitability analysis. The External Investment Manager considers for exclusion of the portfolio issuers which have been rated by the External Investment Manager as having “Very High” or “High” Fundamental ESG (Risk) Rating.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of the investment strategy.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

The good governance requirements outlined in the SFDR regulation are only applicable to investments in companies.

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the Management Company “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

## ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

The Sub-Fund invests predominantly in sovereign issuers and thus the “good governance” test does not apply to this category of issuers.

Nonetheless, the External Investment Manager has in place a good governance methodology when it comes to consider state-owned companies, sovereign agencies and sovereigns, where as part of the Investment Manager’s proprietary ESG evaluation framework, any issuer deemed to have ‘very high’ ESG risks on the governance pillar is automatically assigned a ‘very high’ Fundamental ESG (Risk) Rating overall, and consequently systematically excluded from investment..



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the

**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

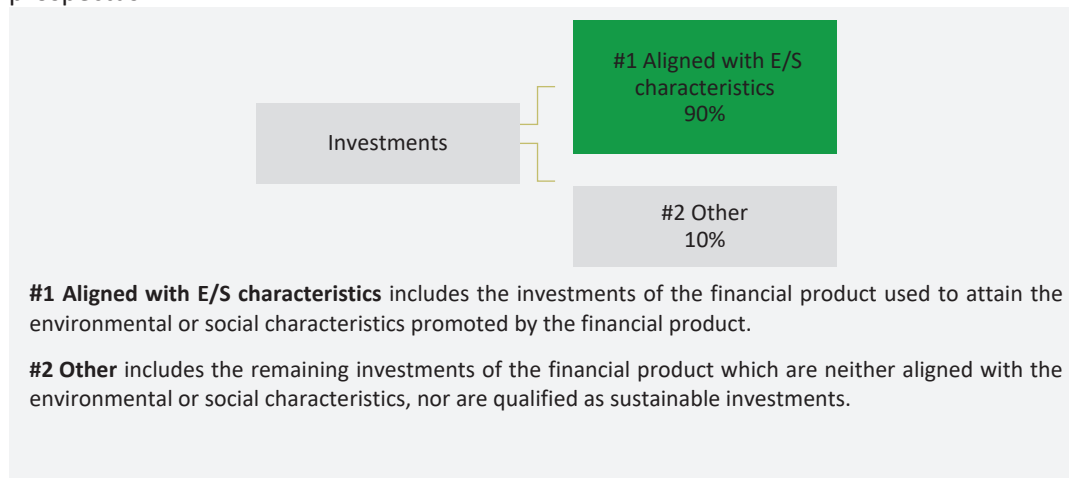
## ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

prospectus.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>2</sup>?**

Yes:

In fossil gas     In nuclear energy

No

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

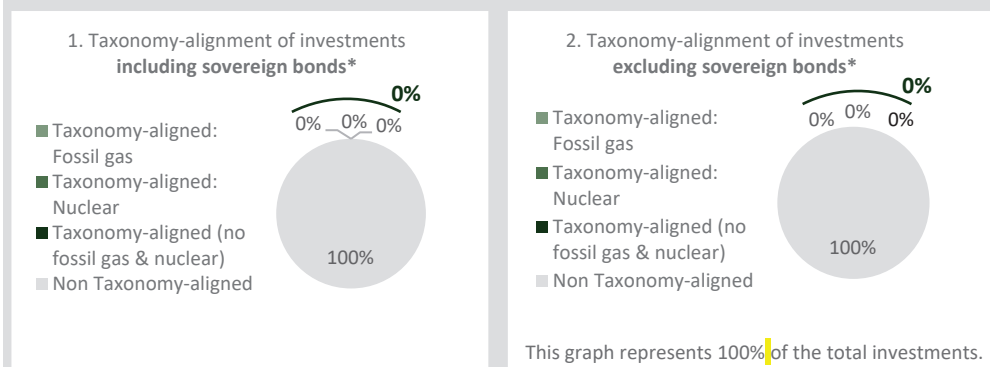
<sup>2</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.



## ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

## ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***  
Not Applicable
- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***  
Not Applicable
- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***  
Not Applicable
- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***  
Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities

**Legal entity identifier:**

636700ZWYDAMOG8CPE12

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

### Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

## ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are flexible in ESG best-practice.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions - Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions - Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

## ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

## ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

The external investment manager integrates ESG analysis at every stage of its investment process: in the initial selection of the investable universe, in the idea generation process, in the stock analysis phase through detailed company research, identifying leaders and laggards, and in the portfolio construction phase. In the portfolio construction phase, the external investment manager's goal is to build a diversified portfolio of companies with strong ESG profiles.

The integrated investment process begins with screening the initial universe based on ESG and financial considerations (e.g., company involvement in weapons manufacturing, gambling, alcohol, tobacco, coal mining). In addition to these absolute exclusions, the external investment manager will exclude companies that do not meet its overall Comprehensive ESG Guidelines. The external investment manager's ESG research department has built a proprietary research process over the past couple decades (supported by and complemented with third-party research) to evaluate the sustainable characteristics of a broad set of global companies.

Beyond the initial universe screening, the focus of the external investment manager's research process is bottom-up and fundamental. The external investment manager has developed a dynamic "monitor list" drawing upon the fundamental inputs from both the ESG and the financial analyst teams. Using an ESG lens, the external investment manager examines the material risks and opportunities that impact companies in a specific sector. The ESG team presents the analysis of the material issues in each sector, highlighting emerging issues, best in class practices, risks, and opportunities. They also benchmark leaders and laggards in each sector, providing ideas for the financial analysts. Similarly, the financial analysts use their global sector experience and expertise to generate stock specific ideas in their sectors, monitoring holdings and candidate stocks while tracking sector, industry and market dynamics. The external investment manager combines the financial analyst's rigorous bottom-up analysis with the holistic understanding of the company's ESG profile. As a result of this integrated financial and ESG analysis, the monitor list is narrowed down to a focus list.

The portfolio management team draws from the pool of names on the focus list to create a diversified portfolio. Using the stocks which have been vetted and approved by both teams, the portfolio manager constructs the portfolio. The external investment manager assesses the financial and ESG risks and opportunities and prefers to buy the companies that have a large exposure in revenues (>50%) to the three long-term sustainable themes mentioned above (i.e., the external investment manager will qualify them as "Solutions Providers"). The external investment manager seeks companies that are sustainability leaders, with responsible practices and innovative products or services. However, in order to build a diversified portfolio, the external investment manager may also invest in high quality companies that meet or exceed the external investment manager's Comprehensive ESG guidelines but are not yet leaders in sustainability. In these instances, the external investment manager aims to raise the sustainability profile of the equity holdings by urging the management of the portfolio companies to improve upon their policies and operations through the external investment manager's active shareholder engagement. The external investment manager uses several approaches in its shareholder engagement including active dialogue, proxy voting, and other sector level strategies such as public benchmarking or improving industry standards in order to generate positive ESG momentum. In this respect, the external investment manager aligns their interest with that of the company.

**ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities**  
 Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a,  
 of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Companies that do not pass the external investment manager's ESG suitability analysis. The integrated investment process begins with screening the initial universe based on ESG and financial considerations (e.g., company involvement in weapons manufacturing, gambling, alcohol, tobacco, coal mining). In addition to these absolute exclusions, the external investment manager will exclude companies that do not meet its overall Comprehensive ESG Guidelines.

## ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

- **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.



## ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The external investment manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. This external investment manager assesses prospective investments for issues relating but not limited to ownership and control, board structure, board diversity, pay practices, accounting and tax practices, political and lobbying practices, and stakeholder engagement.

The external investment manager reviews policies, such as codes of conduct and anti-bribery and corruption policies, as well as compliance infrastructure to assess governance practices. The external investment manager examines the history and pattern of corporate behaviour going back five years and assesses remediation of governance controversies.



**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

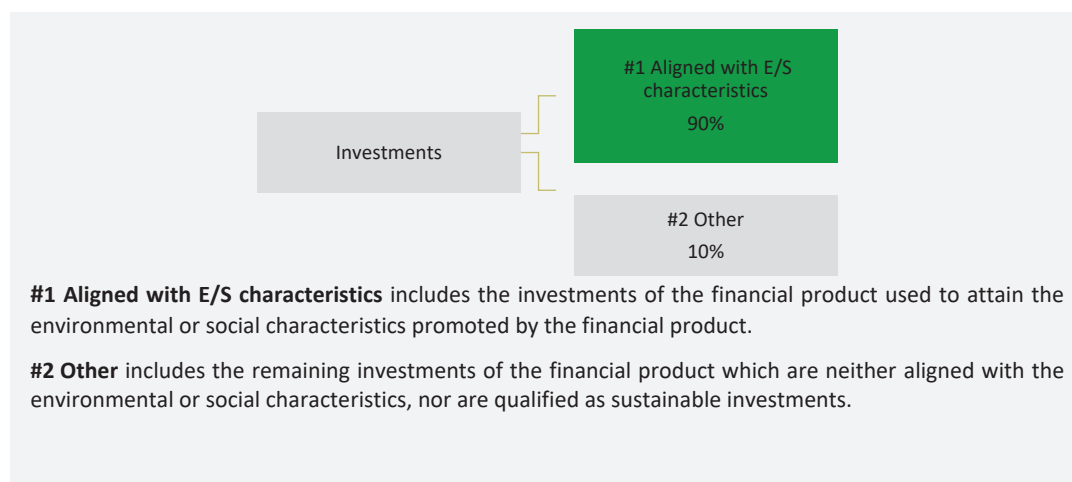
### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



### To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

## ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities

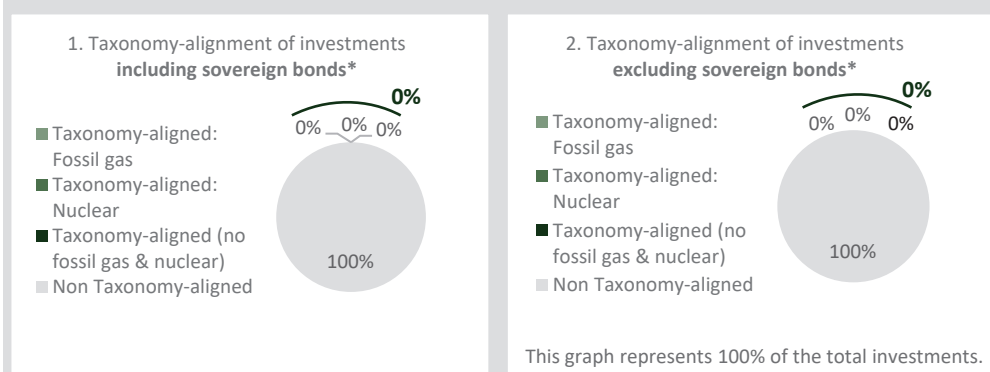
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

### Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?

- Yes:
- In fossil gas  In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html):  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- [Documents of the Sub-Fund](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html):  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Boston Common US Sustainable Equities

**Legal entity identifier:**

549300M1TS3IMJWP4718

### Sustainable investment objective

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

**Does this financial product have a sustainable investment objective?**

<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Yes	<input type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="checkbox"/> No
<p><input checked="" type="checkbox"/> It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: 50%</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> </ul> <p><input checked="" type="checkbox"/> It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: 25%</p>	<p><input type="checkbox"/> It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> <li><input type="checkbox"/> with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> <li><input type="checkbox"/> with a social objective</li> </ul> <p><input type="checkbox"/> It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments</p>



**What is the sustainable investment objective of this financial product?**

ABN AMRO Boston Common US Sustainable Equities (the “Sub-Fund”) follows a multi-thematic sustainable investment strategy. The portfolio will be composed of companies exposed to three long-term sustainable themes, namely (i) climate change and earth renewal, (ii) inclusion and empowerment and (iii) health and community well-being. Within the climate change and earth renewal theme, the Sub-Fund seeks to achieve positive environmental impact by investing primarily in companies that are leading the way to a zero-carbon economy.

The sustainable investment objective of the Sub-Fund is to be aligned with the 2015 Paris Agreement, where world governments committed to curbing global temperature rise to below 2°C above pre-industrial levels. The Sub-Fund aims to achieve an aggregated portfolio temperature below 2°C, using the external data provider ISS and in particular its

## ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

scenario alignment data which is based on the International Energy Agency's Sustainable Development Scenario. The approach used is based on three climate scenarios provided by the International Energy Agency (IEA) in their report World Energy Outlook 2019. The report presents three scenarios, Sustainable Development Scenario (SDS), Stated Policy Scenario (STEPS) and Current Policy Scenario (CPS). Each scenario expects a certain level of carbon budget and temperature increase in 2050. Each scenario is tied to a carbon budget. A carbon budget specifies the amount of fossil carbon that can be combusted worldwide to remain within a certain temperature. The carbon budget changes depending on scenario. For example, to remain within the limits of the SDS, less carbon can be combusted compared to the scenarios that expect a significant temperature increase i.e. the CPS. The Sub-Fund relies on the Sustainable Development Scenario pathway which is fully aligned with the Paris Agreement by holding the rise in global temperatures to “well below 2°C and pursuing efforts to limit it to 1.5°C”. The approach is in line with the expectations of the Commission Delegated Regulation (EU) 2020/1818 in terms of GHG scopes, calculations and trajectories methodologies. In addition, as part of its social sustainable investment objective, the Sub-Fund invests in companies contributing positively to social solutions. To define the sustainable investment universe, a “pass-fail” approach is used using a set of criteria. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the sustainable objectives followed by the Sub-Fund.

### ● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The analysis of certain sustainability indicators is systematically integrated into the investment decision making process. The attainment of the sustainable investment objectives is assessed by investing in securities financing economic activities that substantially contribute to the environmental and/or social objectives mentioned above. To define the sustainable investment universe, a “pass-fail” approach is used using a set of criteria. No other criteria than the ones mentioned below are used to define the sustainable investment nature of an investment. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe.

To be eligible to the investment universe, the Management Company uses the below criteria:

- o Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is assessed by data sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed Science Based Target (SBT)", or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets.
- o Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company's estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
- o Having a net positive aggregated Overall SDG Score by reference to the Sustainable Development Goals. The criterion is sourced from the external data

**Sustainability indicators** measure how the sustainable objectives of this financial product are attained.

## ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

provider ISS. This criterion assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer's product portfolio on the achievement of sustainability objectives that align with the UN SDGs. For corporate issuers the SDG Solutions Score considers only the most distinct objectives scores, i.e., the highest positive and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solutions Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.

- o Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of the above criteria or (ii) a different view of the company's impact assessment leveraging the External Investment Manager's proprietary methodology.

### ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

The "Do No Significant Harm" (DNSH) principle is compiled by taking into account adverse impacts indicators listed in the Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022. The Sub-Fund takes into consideration (for some of them using proxies) all the mandatory adverse impact indicators listed in Table 1 of Annex 1 that are applicable to investee companies.

In addition, the Sub-Fund takes into consideration PAI No. 4 in Table 2 of Annex 2, applicable to investee companies, relating to investments in companies without carbon reduction initiatives. The Sub-Fund also takes into consideration PAI No. 15 of Table 3 of Annex 1, applicable to investee companies, relating to the lack of anti-corruption and anti-bribery policies.

### ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

The Sub-Fund considers adverse impacts of its investments on society and the environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusions of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 and 16 in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator "investing in companies without carbon emission reduction initiatives" (i.e., PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the optional indicator "lack of anti-corruption and anti-bribery policies" (i.e., PAI 15) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

## ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

### *How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:*

The Sub-Fund's sustainable investments are aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights, including the principles and rights set forth in the 8 "fundamental" conventions identified in the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work (covering subjects considered to be fundamental principles and rights at work, e.g., freedom of association and the right to collective bargaining, the elimination of all forms of forced or compulsory labour, the effective abolition of child labour, and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation) and the International Bill of Human Rights.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers adverse impacts of its investments on society and the environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusion of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 and 16 in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator "investing in companies without carbon emission reduction initiatives" (i.e., PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the optional indicator "lack of anti-corruption and anti-bribery policies" (i.e. PAI 15) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

### What investment strategy does this financial product follow?

The external investment manager integrates ESG analysis at every stage of its investment process: in the initial selection of the investable universe, in the idea generation process, in the stock analysis phase through detailed company research, identifying leaders and laggards, and in the portfolio construction phase. In the portfolio construction phase, the external investment manager's goal is to build a diversified portfolio of companies with strong ESG profiles that align with three long-term sustainable themes namely climate change and earth renewal, inclusion and empowerment as well as health and community well-being.

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## **ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities**

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The integrated investment process begins with screening the initial universe based on ESG and financial considerations (e.g., company involvement in weapons manufacturing, gambling, alcohol, tobacco, coal mining). In addition to these absolute exclusions, the external investment manager will exclude companies that do not meet its overall Comprehensive ESG Guidelines. The external investment manager's ESG research department has built a proprietary research process over the past couple decades (supported by and complemented with third-party research) to evaluate the sustainable characteristics of a broad set of global companies.

Beyond the initial universe screening, the focus of the external investment manager's research process is bottom-up and fundamental. The external investment manager has developed a dynamic "monitor list" drawing upon the fundamental inputs from both the ESG and the financial analyst teams. Using an ESG lens, the external investment manager examines the material risks and opportunities that impact companies in a specific sector. The ESG team presents the analysis of the material issues in each sector, highlighting emerging issues, best in class practices, risks, and opportunities. They also benchmark leaders and laggards in each sector, providing ideas for the financial analysts. Similarly, the financial analysts use their global sector experience and expertise to generate stock specific ideas in their sectors, monitoring holdings and candidate stocks while tracking sector, industry and market dynamics. The external investment manager combines the financial analyst's rigorous bottom-up analysis with the holistic understanding of the company's ESG profile. As a result of this integrated financial and ESG analysis, the monitor list is narrowed down to a focus list.

The portfolio management team draws from the pool of names on the focus list to create a diversified portfolio. Using the stocks which have been vetted and approved by both teams, the portfolio manager constructs the portfolio. The external investment manager assesses the financial and ESG risks and opportunities and prefers to buy the companies that have a large exposure in revenues (>50%) to the three long-term sustainable themes mentioned above (i.e., the external investment manager will qualify them as "Solutions Providers"). The external investment manager seeks companies that are sustainability leaders, with responsible practices and innovative products or services. However, in order to build a diversified portfolio, the external investment manager may also invest in high quality companies that meet or exceed the external investment manager's Comprehensive ESG guidelines but are not yet leaders in sustainability. As such, companies with less than 50% of exposure to the three long-term sustainable themes mentioned above and that demonstrate average yet improving ESG profiles (i.e., the external investment manager will qualify them as "ESG Momentum") as well as companies with less than 50% of exposure to the three long-term sustainable themes mentioned above and that demonstrate leading ESG profiles relative to the industry group (i.e., the external investment manager qualify them as "ESG Leaders") are also considered for investments. In these instances, the external investment manager aims to raise the sustainability profile of the equity holdings by urging the management of the portfolio companies to improve upon their policies and operations through the external investment manager's active shareholder engagement. The external investment manager uses several approaches in its shareholder engagement including active dialogue, proxy voting, and other sector level strategies such as public benchmarking or improving industry standards in order to generate positive ESG momentum. In this respect, the external investment manager aligns their interest with that of the company.



## ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies non-compliant with SFDR Sustainable Investments mandatory norms and conventions	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Companies that do not pass the external investment manager's ESG suitability analysis. The integrated investment process begins with screening the initial universe based on ESG and financial considerations (e.g., company involvement in weapons manufacturing, gambling, alcohol, tobacco, coal mining). In addition to these absolute exclusions, the external investment manager will exclude companies that do not meet its overall Comprehensive ESG Guidelines.

## ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Sustainable investment eligibility criteria (the below criteria may not be cumulative):
  - Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is assessed by data sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed Science Based Target (SBT)", or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets.
  - Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company's estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
  - Having a net positive aggregated Overall SDG Score by reference to the Sustainable Development Goals. The criterion is sourced from the external data provider ISS. This criterion assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer's product portfolio on the achievement of sustainability objectives. that align with the UN SDGs For corporate issuers the SDG Solutions Score considers only the most distinct objectives scores, i.e., the highest positive and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solutions Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.
  - Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of the above criteria or (ii) a differentiated view of the company's impact assessment leveraging the External Investment Manager's proprietary methodology.

### ● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its "Good Governance Policy", the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS "exclusion policy" are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

#### **Good governance**

practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

## ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

The external investment manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. This external investment manager assesses prospective investments for issues relating but not limited to ownership and control, board structure, board diversity, pay practices, accounting and tax practices, political and lobbying practices, and stakeholder engagement. The external investment manager reviews policies, such as codes of conduct and anti-bribery and corruption policies, as well as compliance infrastructure to assess governance practices. The external investment manager examines the history and pattern of corporate behaviour going back five years and assesses remediation of governance controversies.

## ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

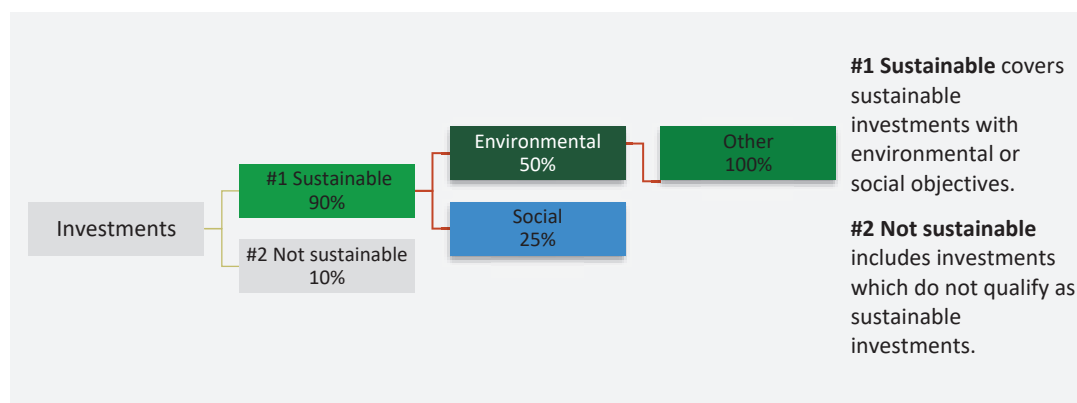
### What is the asset allocation and the minimum share of sustainable investments?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the sustainable investment process in place, hence in investments that are defined as sustainable (#1 Sustainable). The external investment manager’s proprietary sustainable analysis covers 100% of the “#1 Sustainable” investments.” #1 Sustainable” investments include a minimum of 50% assets with environmental objectives and 25% with social objectives. Investments with environmental objectives are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy.

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Not Sustainable). “#2 Not Sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging purpose as a technique of portfolio management efficiency. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



#### ● How does the use of derivatives attain the sustainable investment objective?

Not Applicable



### To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund's sustainable investments with an environmental objective are not aligned with the EU taxonomy (i.e. 0%) as the investments with an environmental objective are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU taxonomy.

## ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

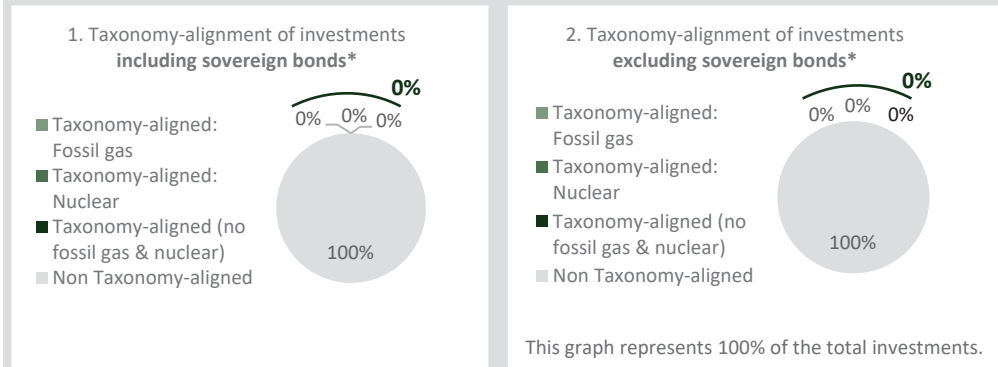
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

- Yes:
  - In fossil gas
  - In nuclear energy
- No

*The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



**What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

The minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy is 100%. The Sub-Fund commits to make a minimum of 50% sustainable investments with an environmental objective not aligned with the EU Taxonomy.

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund commits to make a 25% minimum share of sustainable investments with a social objective.



### What investments are included under “#2 Not sustainable”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Not Sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging purpose as a technique of portfolio management efficiency. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to meet the sustainable investment objective?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- **How does the reference benchmark take into account sustainability factors in a way that is continuously aligned with the sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?**

Not Applicable

- **How does the designated index differ from a relevant broad market index?**

Not Applicable

- **Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?**

Not Applicable

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- **ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:**  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>

## **ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities**

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Documents of the Sub-Fund:

<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

## ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities

**Legal entity identifier:**

549300DK7XYE4LPM8645

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities (the "Sub-Fund"). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the "Management Company") ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall



## ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are flexible in ESG best-practice.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions - Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions - Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

## ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

## ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. The strategy is actively managed through a proprietary ESG fundamental research driven approach and is complemented by an engagement approach. The ESG assessment includes a value-based screening and an in-depth ESG review.

The selection process of the external investment manager starts with the implementation of a quantitative screening by looking for data points indicative of the level of quality of the companies and on valuation criteria. The objective of this first screening is to narrow the initial universe of 1.000 companies to roughly 250. Then through fundamental analysis affirming the financial and business model sustainability quality, and the company valuation, the list is narrowed again to an “Approved list” of roughly 175 companies. Finally, the dedicated in-house ESG research and engagement team of the external investment manager (“the ESG analysts”) that is responsible for ESG exclusions and ESG assessments, will conduct an in-depth analysis to come to a “pass” or “fail” recommendation.

For each potential investment, the ESG analysts of the external investment manager seek to understand the full spectrum of the company’s product and services. The team will apply its value-based screen by excluding companies engaged in specific products or practices considering their revenue dependence, market share and severity (as weapons, gaming, tobacco, Alcohol production, in Factory farming, in nuclear power fuel cycle and in Prison operations. etc.). The team will then evaluate the overall performance in four broad categories: corporate, governance, human capital management and environmental & community impacts. Using a proprietary “materiality framework,” the ESG team of the external investment manager assesses the potential significance of ESG factors (with respect to a range of issues, encompassing both risks and opportunities) to include them into the overall assessment of the company’s quality, business model sustainability, and valuation.

The concluding step of this process is a “pass” or “fail” recommendation from the ESG analysts for each company complementing by a comprehensive report. The selection process leads to reject above 20% of the companies of the “Approved list”. The companies eligible to the strategy are put on the “Approved screened list” composed usually of 125 companies.

In complement, the external investment company may engage with companies on certain issues relying on the expertise of its in-house Active Ownership Committee composed of senior ESG professionals and portfolio managers (including the Chief Investment Officer). The team oversees the development of the firm’s core engagement strategy and plans each year.

Methodological limitations can be assessed in terms of nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

## ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. The analysis is completed relative to a set of comprehensive guidelines, assessing the company's impact on stakeholders, performance over time (relative to peers and established goals), and transparency. The concluding step of this process is a "pass" or "fail" recommendation based of the External Investment Manager.
- As part of the screening process of the external investment manager, companies involved (considering certain thresholds) in the alcohol production, in factory farming, in nuclear power fuel cycle and in prison operations are not suitable for investment.

## ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

- **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

## ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities

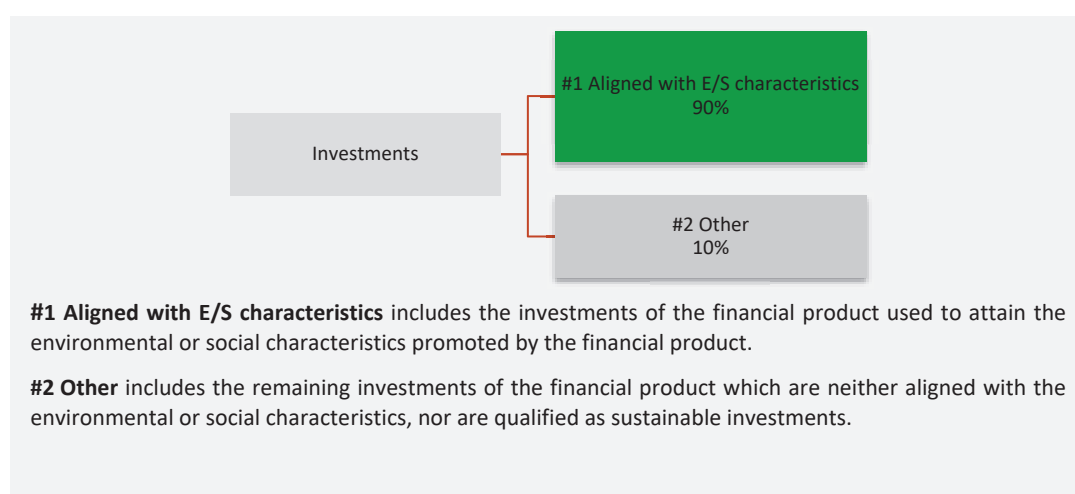
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

## ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities

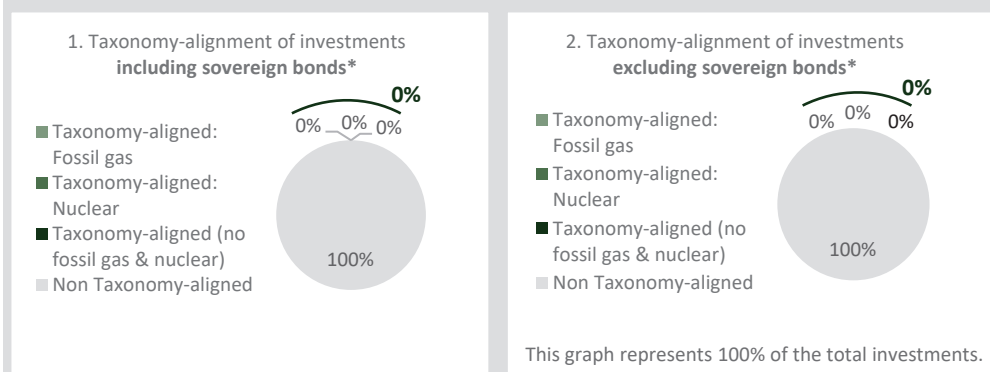
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

- Yes:
- In fossil gas     In nuclear energy
- No

*The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



**What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable



**What is the minimum share of socially sustainable investments?**

Not Applicable

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>

- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.



## ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

**Legal entity identifier:**

549300SL4OLTHYRHP145

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

### Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

## ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.

## ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

## ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG. The external investment manager's uses a proprietary ESG analysis, leading to ESG Rating and scoring, as well as a norms-based and activity-based controversy screening to define the investable universe for the sub fund.

On the corporate side, the external investment manager has developed an analytical framework to identify "Best in Class" companies. Companies are first selected on the basis of controversial sector exclusions and norms-based filtering. Subsequent to this selection, companies are further analysed on the basis of sector-specific development issues. These issues are approached from two distinct but related perspectives, a macro analysis (i.e. business activity analysis) and a micro analysis (i.e. stakeholder analysis). The results of the company and stakeholder analysis are combined and the external investment manager selects the companies with the top 80% scores within the investable universe.

As part of the macro analysis the external investment manager has identified 5 major long term sustainability trends that strongly influence the environment in which companies operate, affecting their future market challenges as well as their long-term growth and prosperity:

- Controversial Activities exclusion,
- Norms-Based Analysis determines whether a company complies with the 10 principles of the UN GC for each of main categories (Human rights), Labour, Environment and anti-Bribery,
- Business Activities Analysis,
- Stakeholders Analysis,
- Stewardship,

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Separately, a micro-analysis examines companies' ability to integrate the interests of six stakeholders into their long-term strategy. Stakeholder relationships create opportunities as well as risks and are thereby drivers of long-term value.

When it comes to the countries and public bonds issuers, the analysis is carried out at the country level. The external investment manager's proprietary process employs a four-pillar, quantifiable approach (i.e. human capital, natural capital, social capital, and economic capital). These four pillars incorporate a wide-range of material ESG issues that are evaluated using a set of key performance indicators. The ESG country score is calculated using a weighted average model. The four key pillars are considered to have equal importance and are therefore equally weighted. Within each pillar, the ESG issues and KPIs are weighted based on relevance.

For the supranational organisations issuing bonds, the external investment manager applies a two-steps process considering (1) the purpose of the Mission Statement Analysis (to exclusively select supranational organisations whose mission favours economic and social development of regions and countries (2). a norms-based analysis to determine whether or not the supranational organisation observes the 10 principles of the United Nations Global Compact.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%

## ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%
<b>Government Exclusions based on Norms and Policies</b>	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes
Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. On the corporate side, the companies with the top 80% ESG scores and taking the External Investment Manager’s proprietary scoring methodology are considered for inclusion in the portfolio. On the countries and public bonds issuers side such as public organisations, the top 75% ESG rated countries and taking into account the External investment Manager’s proprietary methodology are considered for inclusion in the portfolio.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20%.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

## ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

The external investment manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. Corporate governance is a key aspect of the corporate governance of the external investment manager's Stakeholder analysis. It allows to assess how a company interacts with and manages its relevant stakeholders and how a company's board fulfils its governance and management duties with respect to disclosure and transparency as well as the consideration of sustainability objectives.

To assess a company's governance practices, the external investment manager's ESG analysis comprises, among others, 5 key governance pillars:

- Strategic direction which assesses the independence, expertise and composition of the board and ensures that the board acts in the best interests of all

## ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

shareholders and other stakeholders and can act as a counterbalance to management.

- Audit committee & auditor independence evaluation to avoid conflicts of interests.
- Transparency on executive remuneration, which enables executives and the remuneration committee to be held accountable by shareholders and helps align interests of both top executives and shareholders and focus on long term performance.
- Share capital to ensure all shareholders have equal voting rights.
- Financial conduct and transparency.

The good governance requirements outlined in the SFDR regulation are only applicable to investments in companies. Nonetheless, the external investment manager has in place a good governance methodology when it comes to consider state-owned companies, sovereign agencies and sovereigns.



**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

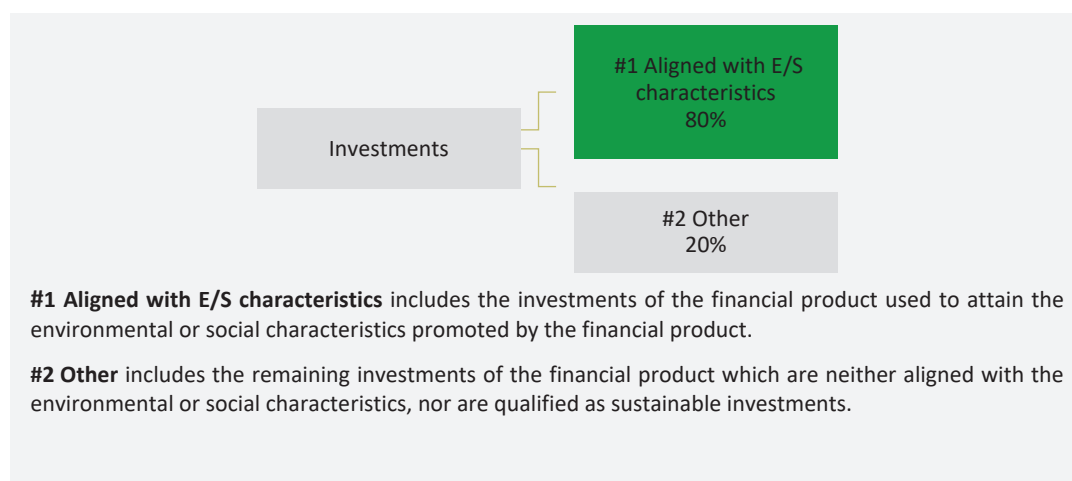
### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



## ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



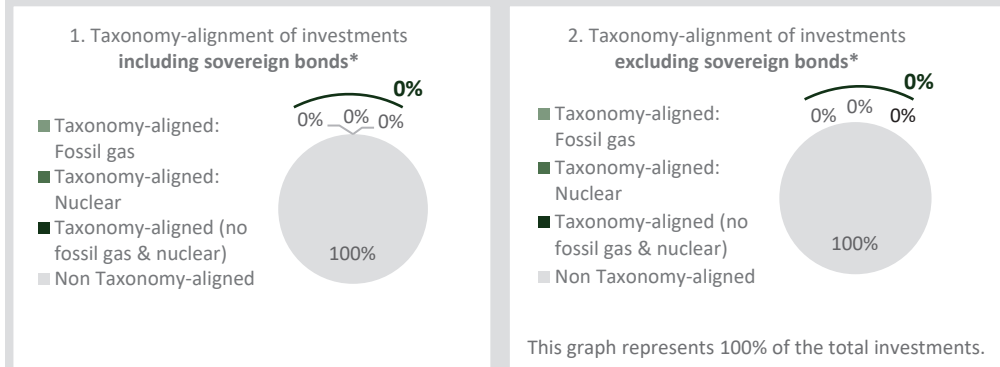
### To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

- Yes:
- In fossil gas     In nuclear energy
- No

*The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

## ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- **How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable

- **How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?**

Not Applicable

- **How does the designated index differ from a relevant broad market index?**

Not Applicable

- **Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?**

Not Applicable

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

## ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

**Legal entity identifier:**

549300L09550N5VH8145

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

### Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds (the "Sub-Fund"). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the "Management Company") ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

## ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.

## ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

## ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund aims to provide short-term capital growth with a diversified and actively managed portfolio of sustainable short term bonds. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

With regard to the environmental and social sustainability aspects of the investment strategy, the external investment manager's uses a proprietary ESG analysis, leading to ESG Rating and scoring, as well as the norms-based and activity-based controversy screening to define the investable universe for the sub fund.

On the corporate side, the external investment manager has developed an analytical framework to identify "Best in Class" companies. Companies are first selected on the basis of controversial sector exclusions and norms-based filtering. Subsequent to this selection, companies are further analysed on the basis of sector-specific development issues. These issues are approached from two distinct but related perspectives, a macro analysis (i.e. business activity analysis) and a micro analysis (i.e. stakeholder analysis). The results of the company and stakeholder analysis are combined and the external investment manager selects the companies with the top 80% scores within the investable universe.

As part of the macro analysis the external investment manager has identified 5 major long term sustainability trends that strongly influence the environment in which companies operate, affecting their future market challenges as well as their long-term growth and prosperity:

- Controversial Activities exclusion,
- Norms-Based Analysis determines whether a company complies with the 10 principles of the UN GC for each of main categories (Human rights), Labour, Environment and anti-Bribery,
- Business Activities Analysis,
- Stakeholders Analysis,

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Stewardship,

Separately, a micro-analysis examines companies' ability to integrate the interests of six stakeholders into their long-term strategy. Stakeholder relationships create opportunities as well as risks and are thereby drivers of long-term value.

When it comes to the countries and public bonds issuers, the analysis is carried out at the country level. The external investment manager's proprietary process employs a four-pillar, quantifiable approach (i.e. human capital, natural capital, social capital, and economic capital). These four pillars incorporate a wide-range of material ESG issues that are evaluated using a set of key performance indicators. The ESG country score is calculated using a weighted average model. The four key pillars are considered to have equal importance and are therefore equally weighted. Within each pillar, the ESG issues and KPIs are weighted based on relevance.

For the supranational organisations issuing bonds, the external investment manager applies a two-steps process considering (1) the purpose of the Mission Statement Analysis (to exclusively select supranational organisations whose mission favours economic and social development of regions and countries (2). a norms-based analysis to determine whether or not the supranational organisation observes the 10 principles of the United Nations Global Compact.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%

## ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%
<b>Government Exclusions based on Norms and Policies</b>	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes
Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. On the corporate side, the companies with the top 80% ESG scores and taking the External Investment Manager’s proprietary scoring methodology are considered for inclusion in the portfolio. On the countries and public bonds issuers side such as public organisations, the top 75% ESG rated countries and taking into account the External investment Manager’s proprietary methodology are considered for inclusion in the portfolio.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.



## ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

The external investment manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. Corporate governance is a key aspect of the corporate governance of the external investment manager's Stakeholder analysis. It allows to assess how a company interacts with and manages its relevant stakeholders and how a company's board fulfils its governance and management duties with respect to disclosure and transparency as well as the consideration of sustainability objectives.

To assess a company's governance practices, the external investment manager's ESG analysis comprises, among others, 5 key governance pillars:

- Strategic direction which assesses the independence, expertise and composition of the board and ensures that the board acts in the best interests of all

## ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

shareholders and other stakeholders and can act as a counterbalance to management.

- Audit committee & auditor independence evaluation to avoid conflicts of interests.
- Transparency on executive remuneration, which enables executives and the remuneration committee to be held accountable by shareholders and helps align interests of both top executives and shareholders and focus on long term performance.
- Share capital to ensure all shareholders have equal voting rights.
- Financial conduct and transparency.

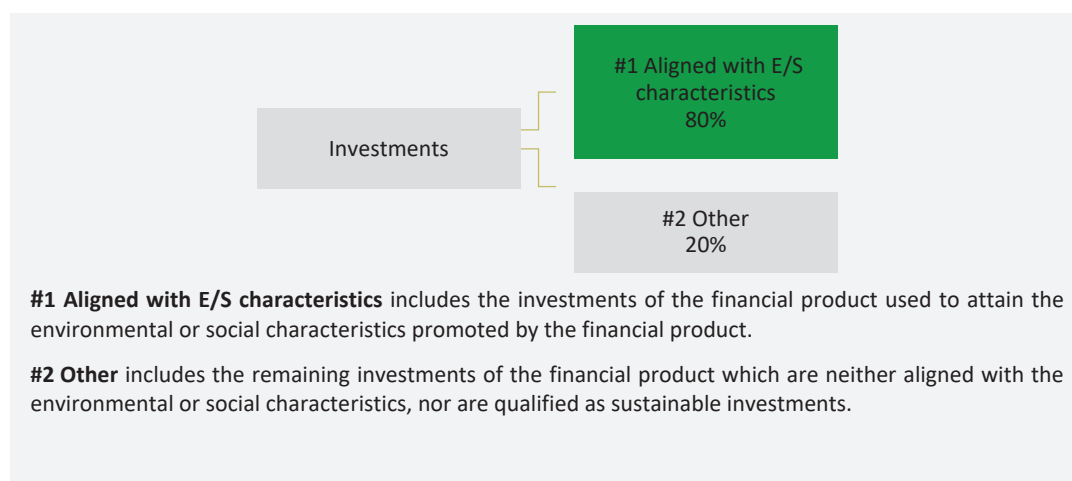
The good governance requirements outlined in the SFDR regulation are only applicable to investments in companies. Nonetheless, the external investment manager has in place a good governance methodology when it comes to consider state-owned companies, sovereign agencies and sovereigns.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable

**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

## ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



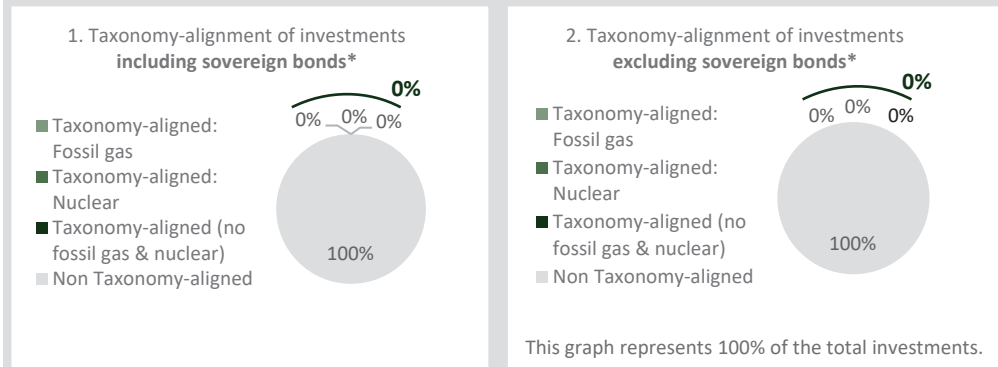
### To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

- Yes:
- In fossil gas     In nuclear energy
- No

*The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

## ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- **How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable

- **How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?**

Not Applicable

- **How does the designated index differ from a relevant broad market index?**

Not Applicable

- **Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?**

Not Applicable

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html):  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- [Documents of the Sub-Fund](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html):  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds**

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

## ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities

**Legal entity identifier:**

549300CBDKNRXFQ1GZ21

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities (the “Sub-Fund”). The External Investment Manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

## ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

## ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



## ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

The External Investment Manager believes that companies which embrace sustainability-related opportunities and challenges in concert with their financial opportunities and challenges are the most likely to generate shareholder value. The Sub-Fund uses a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio is composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG. The external investment manager's uses a proprietary ESG analysis, leading to ESG Rating and scoring, as well as a norms-based and activity-based controversy screening to define the investable universe for the sub fund.

The external investment manager has developed an analytical framework to identify "Best in Class" companies. Companies are first selected on the basis of controversial sector exclusions and norms-based filtering. Subsequent to this selection, companies are further analysed on the basis of sector-specific development issues. These issues are approached from two distinct but related perspectives, a macro analysis (i.e. business activity analysis) and a micro analysis (i.e. stakeholder analysis). The results of the company and stakeholder analysis are combined and the external investment manager selects the companies with the top 50% scores within the investable universe.

As part of the macro analysis the external investment manager has identified 5 major long term sustainability trends that strongly influence the environment in which companies operate, affecting their future market challenges as well as their long-term growth and prosperity:

- Controversial Activities exclusion,
- Norms-Based Analysis determines whether a company complies with the 10 principles of the UN GC for each of main categories (Human rights), Labour, Environment and anti-Bribery,
- Business Activities Analysis,
- Stakeholders Analysis,
- Stewardship,

Separately, a micro-analysis examines companies' ability to integrate the interests of six stakeholders into their long-term strategy. Stakeholder relationships create opportunities as well as risks and are thereby drivers of long-term value.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No

## ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the External Investment Manager ESG suitability analysis. As part of the ESG inclusion selection process of the External investment Manager, are eligible for investment companies that are within the top 50% of the investment universe as defined by the External Investment Manager.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

## ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

The External Investment Manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. Corporate governance is a key aspect of the corporate governance of the External Investment Manager's stakeholder analysis. It allows to assess how a company interacts with and manages its relevant stakeholders and how a company's board fulfils its governance and management duties with respect to disclosure and transparency as well as the consideration of sustainability objectives.

To assess a company's governance practices, the External Investment Manager's ESG analysis comprises, among others, 5 key governance pillars:

- o Strategic direction which assesses the independence, expertise and composition of the board and ensures that the board acts in the best interests of all

## ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

shareholders and other stakeholders and can act as a counterbalance to management.

- o Audit committee & auditor independence evaluation to avoid conflicts of interests.
- o Transparency on executive remuneration, which enables executives and the remuneration committee to be held accountable by shareholders and helps align interests of both top executives and shareholders and focus on long term performance.
- o Share capital to ensure all shareholders have equal voting rights.
- o Financial conduct and transparency.



**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

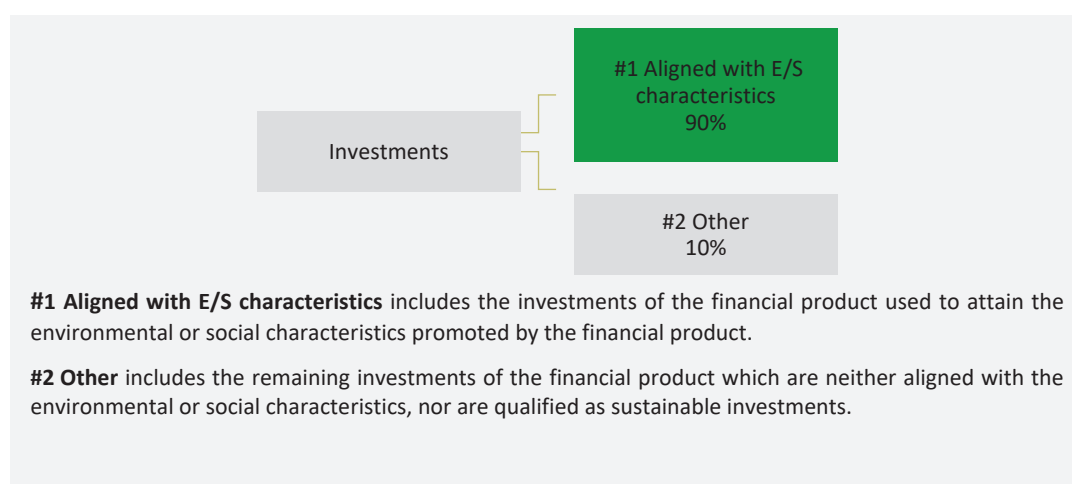
### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



### To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

## ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities

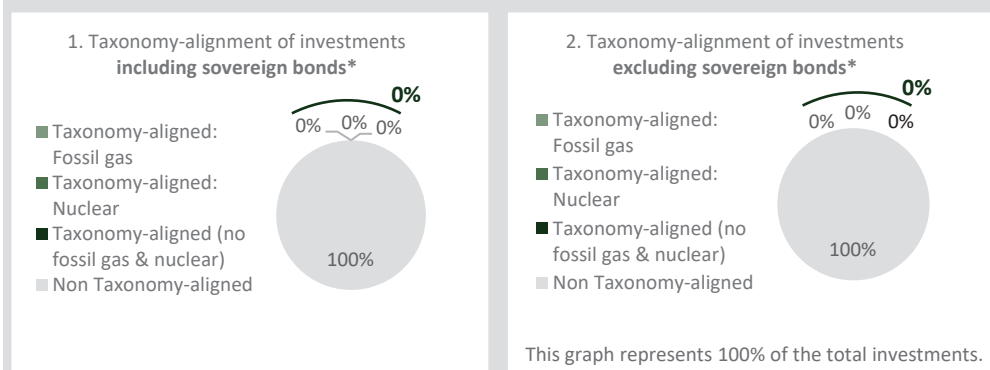
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

### Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?

- Yes:
- In fossil gas  In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html)  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>

- [Documents of the Sub-Fund:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html)  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

**Legal entity identifier:**

549300TEOF7MMQGZFX38

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

### Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities (the "Sub-Fund"). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the "Management Company") ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

## ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.



## ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

## ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

The External Investment Manager seeks reasonably priced quality growth companies which demonstrate a sustainable competitive advantage. The External Investment Manager believes that companies which embrace sustainability-related opportunities and challenges in concert with their financial opportunities and challenges are the most likely to generate shareholder value. The Sub-Fund uses a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The Sub-Fund is composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The external investment manager has developed an analytical framework to identify "Best in Class" companies. Companies are first selected on the basis of controversial sector exclusions and norms-based filtering. Subsequent to this selection, companies are further analysed on the basis of sector-specific development issues. These issues are approached from two distinct but related perspectives, a macro analysis (i.e. business activity analysis) and a micro analysis (i.e. stakeholder analysis). The results of the company and stakeholder analysis are combined and the external investment manager selects the companies with the top 70% scores within the investable universe.

As part of the macro analysis the external investment manager has identified 5 major long term sustainability trends that strongly influence the environment in which companies operate, affecting their future market challenges as well as their long-term growth and prosperity:

- Controversial Activities exclusion,
- Norms-Based Analysis determines whether a company complies with the 10 principles of the UN GC for each of main categories (Human rights), Labour, Environment and anti-Bribery,
- Business Activities Analysis,
- Stakeholders Analysis,
- Stewardship,

Separately, a micro-analysis examines companies' ability to integrate the interests of six stakeholders into their long-term strategy. Stakeholder relationships create opportunities as well as risks and are thereby drivers of long-term value.

In addition and considering the very specific nature of smaller companies, the External Investment Manager designed a portfolio-specific engagement program, taking into account small and mid-caps-specific challenges and favoring long-term dialogue and support rather than exclusion. The External Investment Manager will therefore send a specific engagement questionnaire to each issuer in order to have reliable data for a more accurate analysis and a constructive dialogue.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

## ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the External Investment Manager ESG suitability analysis. As part of the ESG inclusion selection process of the External investment Manager, are eligible for investment companies that are within the top 70% of the investment universe as defined by the External Investment Manager.
- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

## ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

### What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

The External Investment Manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. Corporate governance is a key aspect of the corporate governance of the External Investment Manager's stakeholder analysis. It allows to assess how a company interacts with and manages its relevant stakeholders and how a

## ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

company's board fulfils its governance and management duties with respect to disclosure and transparency as well as the consideration of sustainability objectives.

To assess a company's governance practices, the External Investment Manager's ESG analysis comprises, among others, 5 key governance pillars:

- o Strategic direction which assesses the independence, expertise and composition of the board and ensures that the board acts in the best interests of all shareholders and other stakeholders and can act as a counterbalance to management.
- o Audit committee & auditor independence evaluation to avoid conflicts of interests.
- o Transparency on executive remuneration, which enables executives and the remuneration committee to be held accountable by shareholders and helps align interests of both top executives and shareholders and focus on long term performance.
- o Share capital to ensure all shareholders have equal voting rights.
- o Financial conduct and transparency.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as "eligible" as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). "#2 Other" includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

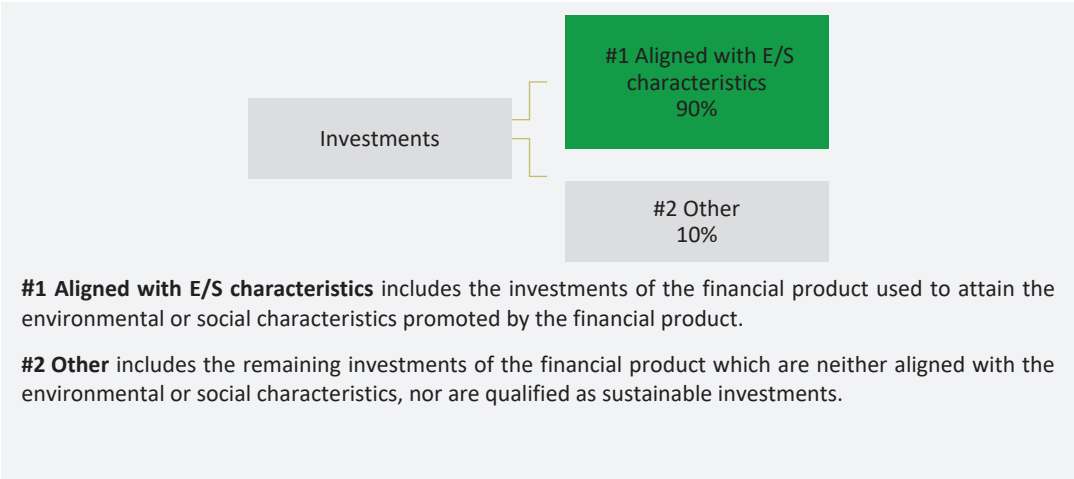
**Asset allocation**  
describes the share  
of investments in  
specific assets.

## ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

Yes:

In fossil gas     In nuclear energy

No

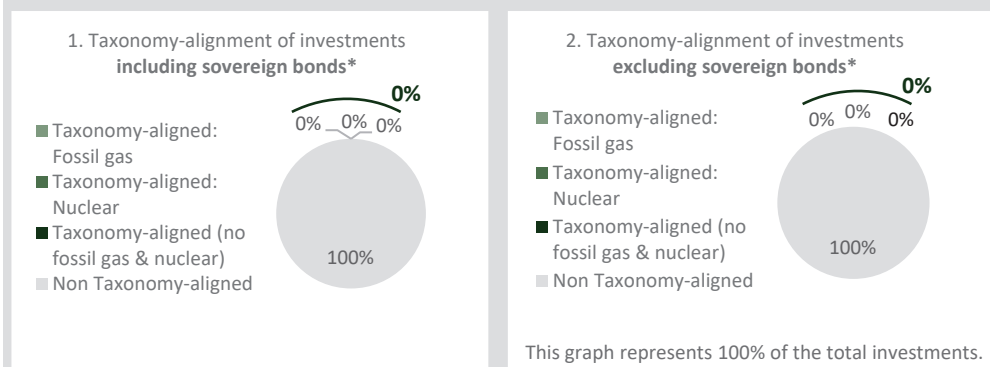
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

## ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?**

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



**Where can I find more product specific information online?**

*More product-specific information can be found on the websites:*

- *ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:*  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- *Documents of the Sub-Fund:*  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.



## ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities Article 8

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities

**Legal entity identifier:**

549300GHUFAZLYYGW322

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall sustainability strengths going from the

## ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities Article 8

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

## ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities Article 8

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

## ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities Article 8

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

The External Investment Manager seeks reasonably priced quality companies which demonstrate a sustainable competitive advantage. The External Investment Manager believes that companies which embrace sustainability-related opportunities and challenges in concert with their financial opportunities and challenges are the most likely to generate shareholder value. The Sub-Fund uses a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio is composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The external investment manager has developed an analytical framework to identify "Best in Class" companies. Companies are first selected on the basis of controversial sector exclusions and norms-based filtering. Subsequent to this selection, companies are further analysed on the basis of sector-specific development issues. These issues are approached from two distinct but related perspectives, a macro analysis (i.e. business activity analysis) and a micro analysis (i.e. stakeholder analysis). The results of the company and stakeholder analysis are combined and the external investment manager selects the companies with the top 80% scores within the investable universe.

As part of the macro analysis the external investment manager has identified 5 major long term sustainability trends that strongly influence the environment in which companies operate, affecting their future market challenges as well as their long-term growth and prosperity:

- Controversial Activities exclusion,
- Norms-Based Analysis determines whether a company complies with the 10 principles of the UN GC for each of main categories (Human rights), Labour, Environment and anti-Bribery,
- Business Activities Analysis,
- Stakeholders Analysis,
- Stewardship,

Separately, a micro-analysis examines companies' ability to integrate the interests of six stakeholders into their long-term strategy. Stakeholder relationships create opportunities as well as risks and are thereby drivers of long-term value.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No

## ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities Article 8

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- As part of the ESG inclusion selection process of the External investment Manager, are eligible for investment companies that score within the first 80% of the universe as defined by the External investment Manager

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

## ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities Article 8

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

Corporate governance is a key aspect of the external investment manager Stakeholder analysis. The external investment manager assesses how a company interacts with and manages its relevant stakeholders as well as how a company's board fulfils its governance and management duties with respect to disclosure and transparency as well as the consideration of sustainability objectives. To assess a company's governance practices, the external investment manager's ESG analysis comprises, among others, 5 key governance pillars:

- o Strategic direction which assesses the independence, expertise and composition of the board and ensures that the board acts in the best interests of all shareholders and other stakeholders and can act as a counterbalance to management.
- o Audit committee & auditor independence evaluation to avoid conflicts of interests.

## ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities Article 8

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

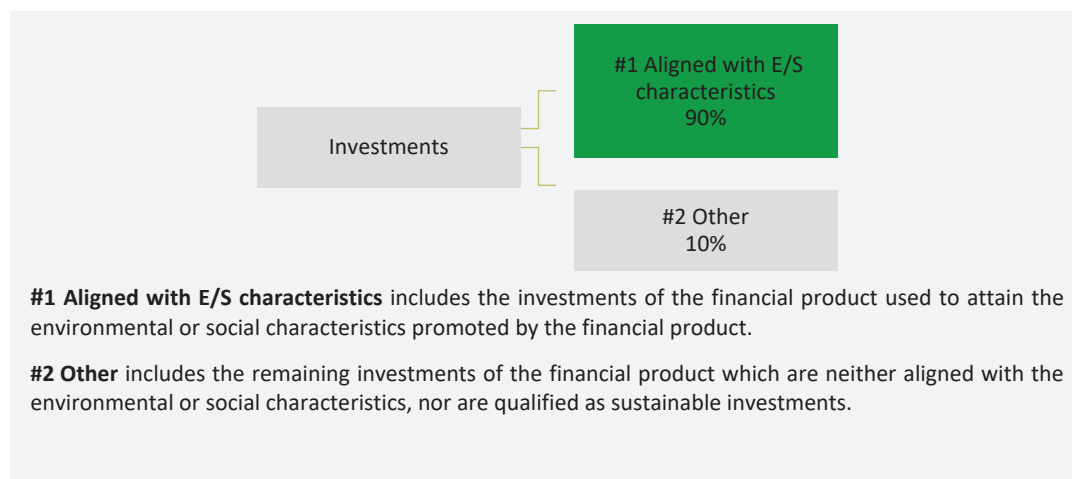
- o Transparency on executive remuneration, which enables executives and the remuneration committee to be held accountable by shareholders and helps align interests of both top executives and shareholders and focus on long term performance.
- o Share capital to ensure all shareholders have equal voting rights.
- o Financial conduct and transparency



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



**#1 Aligned with E/S characteristics** includes the investments of the financial product used to attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product.

**#2 Other** includes the remaining investments of the financial product which are neither aligned with the environmental or social characteristics, nor are qualified as sustainable investments.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



### To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

## ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities Article 8

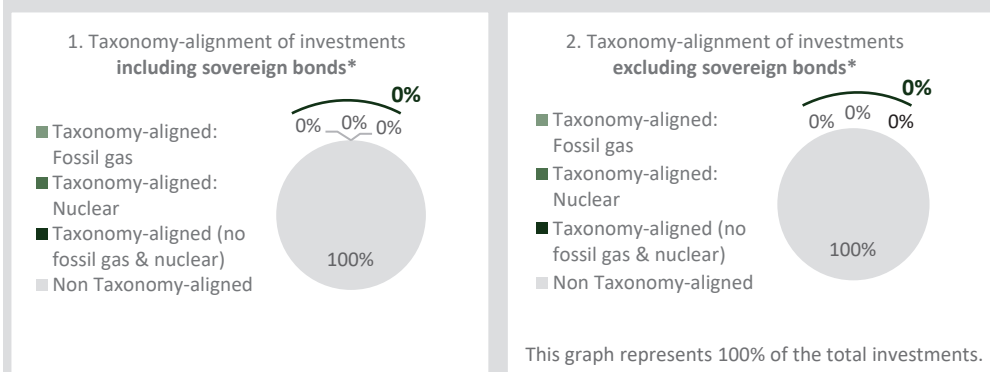
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

- Yes:
- In fossil gas     In nuclear energy
- No

*The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



**What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable



**What is the minimum share of socially sustainable investments?**

Not Applicable

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.



## ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities Article 8

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>

- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

**Legal entity identifier:**

549300GXKI14H8T43734

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

The External Investment Manager will select global convertibles bonds combining a fundamental financial analysis and a top down approach. The investment approach is based on both Credit and Equity analysis carried out by the external investment manager in order to select securities.

The external investment manager's uses a proprietary ESG analysis, leading to ESG Rating and scoring, as well as a norms-based and activity-based controversy screening to define the investable universe for the sub fund.

On the corporate side, the external investment manager has developed an analytical framework to identify "Best in Class" companies. Companies are first selected on the basis of controversial sector exclusions and norms-based filtering. Subsequent to this selection, companies are further analysed on the basis of sector-specific development issues. These issues are approached from two distinct but related perspectives, a macro analysis (i.e. business activity analysis) and a micro analysis (i.e. stakeholder analysis). The results of the company and stakeholder analysis are combined and the external investment manager selects the companies with the top 80% scores within the investable universe.

As part of the macro analysis the external investment manager has identified 5 major long term sustainability trends that strongly influence the environment in which companies operate, affecting their future market challenges as well as their long-term growth and prosperity:

- Controversial Activities exclusion,
- Norms-Based Analysis determines whether a company complies with the 10 principles of the UN GC for each of main categories (Human rights), Labour, Environment and anti-Bribery,
- Business Activities Analysis,
- Stakeholders Analysis,
- Stewardship,

Separately, a micro-analysis examines companies' ability to integrate the interests of six stakeholders into their long-term strategy. Stakeholder relationships create opportunities as well as risks and are thereby drivers of long-term value.

The results of the company analysis and of the stakeholders analysis are combined to form the ESG score; the External Investment Manager will select the companies with the top 80% scores within the investable universe.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the External Investment Manager ESG suitability analysis. The External Investment Manager will consider for inclusion into the portfolio of the Sub-Fund, companies with the top 80% ESG scores (taking the External Investment Manager's proprietary scoring methodology).
- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

### ● **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

The external investment manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. Corporate governance is a key aspect of the corporate governance of the external investment manager's Stakeholder analysis. It allows to assess how a company interacts with and manages its relevant stakeholders and how a

## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

company's board fulfils its governance and management duties with respect to disclosure and transparency as well as the consideration of sustainability objectives.

To assess a company's governance practices, the external investment manager's ESG analysis comprises, among others, 5 key governance pillars:

- Strategic direction which assesses the independence, expertise and composition of the board and ensures that the board acts in the best interests of all shareholders and other stakeholders and can act as a counterbalance to management.
- Audit committee & auditor independence evaluation to avoid conflicts of interests.
- Transparency on executive remuneration, which enables executives and the remuneration committee to be held accountable by shareholders and helps align interests of both top executives and shareholders and focus on long term performance.
- Share capital to ensure all shareholders have equal voting rights.
- Financial conduct and transparency.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 70% of its net assets in assets that have been determined as "eligible" as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 30% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). "#2 Other" includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

**Asset allocation**  
describes the share  
of investments in  
specific assets.

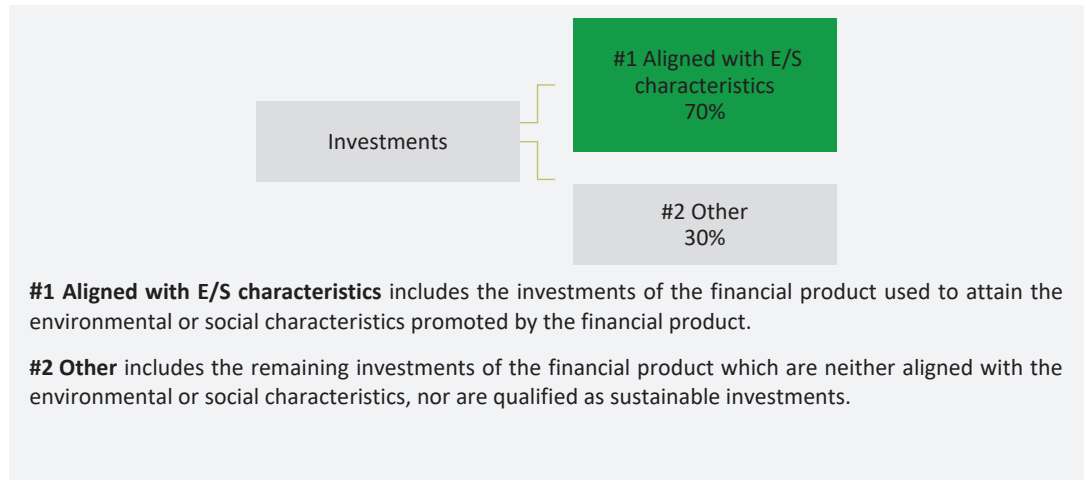


## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

Yes:

In fossil gas

In nuclear energy

No

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### ● What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?**

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



**Where can I find more product specific information online?**

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

**Legal entity identifier:**

549300H8VYJL694NE413

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.

## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG. The external investment manager's uses a proprietary ESG analysis, leading to ESG Rating and scoring, as well as a norms-based and activity-based controversy screening to define the investable universe for the sub fund.

On the corporate side, the external investment manager has developed an analytical framework to identify "Best in Class" companies. Companies are first selected on the basis of controversial sector exclusions and norms-based filtering. Subsequent to this selection, companies are further analysed on the basis of sector-specific development issues. These issues are approached from two distinct but related perspectives, a macro analysis (i.e. business activity analysis) and a micro analysis (i.e. stakeholder analysis). The results of the company and stakeholder analysis are combined and the external investment manager selects the companies with the top 80% scores within the investable universe.

As part of the macro analysis the external investment manager has identified 5 major long term sustainability trends that strongly influence the environment in which companies operate, affecting their future market challenges as well as their long-term growth and prosperity:

- Controversial Activities exclusion,
- Norms-Based Analysis determines whether a company complies with the 10 principles of the UN GC for each of main categories (Human rights), Labour, Environment and anti-Bribery,
- Business Activities Analysis,
- Stakeholders Analysis,
- Stewardship,

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Separately, a micro-analysis examines companies' ability to integrate the interests of six stakeholders into their long-term strategy. Stakeholder relationships create opportunities as well as risks and are thereby drivers of long-term value.

When it comes to the countries and public bonds issuers, the analysis is carried out at the country level. The external investment manager's proprietary process employs a four-pillar, quantifiable approach (i.e. human capital, natural capital, social capital, and economic capital). These four pillars incorporate a wide-range of material ESG issues that are evaluated using a set of key performance indicators. The ESG country score is calculated using a weighted average model. The four key pillars are considered to have equal importance and are therefore equally weighted. Within each pillar, the ESG issues and KPIs are weighted based on relevance.

For the supranational organisations issuing bonds, the external investment manager applies a two-steps process considering (1) the purpose of the Mission Statement Analysis (to exclusively select supranational organisations whose mission favours economic and social development of regions and countries (2). a norms-based analysis to determine whether or not the supranational organisation observes the 10 principles of the United Nations Global Compact.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%



## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%
<b>Government Exclusions based on Norms and Policies</b>	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes
Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. On the corporate side, the companies with the top 80% ESG scores and taking the External Investment Manager's proprietary scoring methodology are considered for inclusion in the portfolio. On the countries and public bonds issuers side such as public organisations, the top 75% ESG rated countries and taking into account the External investment Manager's proprietary methodology are considered for inclusion in the portfolio.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its "Good Governance Policy", the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS "exclusion policy" are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

The external investment manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. Corporate governance is a key aspect of the corporate governance of the external investment manager's Stakeholder analysis. It allows to assess how a company interacts with and manages its relevant stakeholders and how a company's board fulfils its governance and management duties with respect to disclosure and transparency as well as the consideration of sustainability objectives. To assess a company's governance practices, the external investment manager's ESG analysis comprises, among others, 5 key governance pillars:

- o Strategic direction which assesses the independence, expertise and composition of the board and ensures that the board acts in the best interests of all shareholders and other stakeholders and can act as a counterbalance to management.

## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- o Audit committee & auditor independence evaluation to avoid conflicts of interests.
- o Transparency on executive remuneration, which enables executives and the remuneration committee to be held accountable by shareholders and helps align interests of both top executives and shareholders and focus on long term performance.
- o Share capital to ensure all shareholders have equal voting rights.
- o Financial conduct and transparency.

The good governance requirements outlined in the SFDR regulation are only applicable to investments in companies. Nonetheless, the external investment manager has in place a good governance methodology when it comes to consider state-owned companies, sovereign agencies and sovereigns.



**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

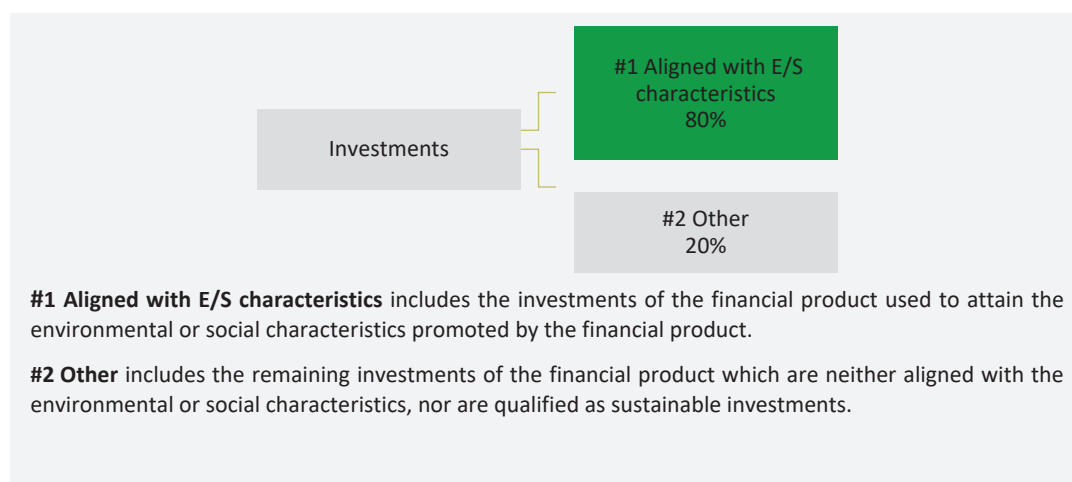
### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable

## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



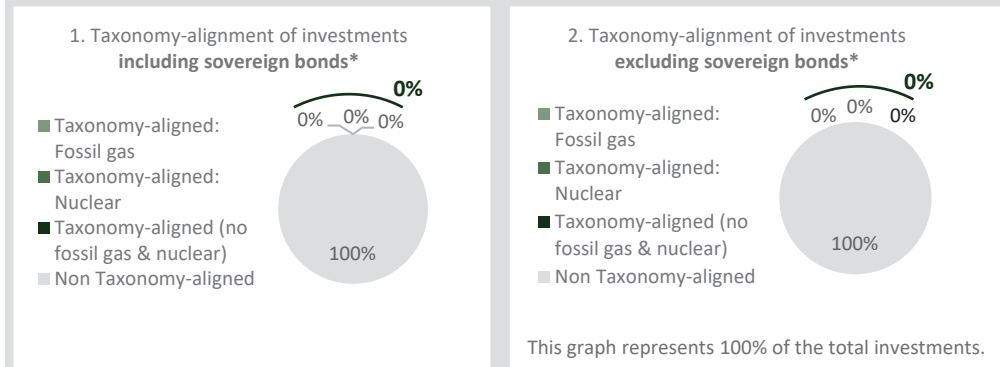
### To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

- Yes:
- In fossil gas     In nuclear energy
- No

*The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

## ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- **How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable

- **How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?**

Not Applicable

- **How does the designated index differ from a relevant broad market index?**

Not Applicable

- **Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?**

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

**Legal entity identifier:**

549300EZ6OEX5H1FKA94

### Sustainable investment objective

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

**Does this financial product have a sustainable investment objective?**

<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Yes	<input type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="checkbox"/> No
<p><input checked="" type="checkbox"/> It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: 50%</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> </ul> <p><input checked="" type="checkbox"/> It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: 25%</p>	<p><input type="checkbox"/> It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> <li><input type="checkbox"/> with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> <li><input type="checkbox"/> with a social objective</li> </ul> <p><input type="checkbox"/> It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments</p>



**What is the sustainable investment objective of this financial product?**

ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities (the “Sub-Fund”) follows a multi-thematic sustainable investment strategy. The portfolio will be composed of issuers exposed to four long-term sustainable themes, namely (i) education, (ii) health and wellbeing, (iii) social infrastructure and (iv) sustainable solutions.

The sustainable investment objective of the Sub-Fund is to be aligned with the 2015 Paris Agreement, where world governments committed to curbing global temperature rise to below 2°C above pre-industrial levels. The Sub-Fund aims to achieve an aggregated portfolio temperature below 2°C, using the external data provider ISS and in particular its scenario alignment data which is based on the International Energy Agency's Sustainable Development Scenario. The approach used is based on three climate scenarios provided by the International Energy Agency (IEA) in their report World Energy Outlook 2019. The report

## ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

presents three scenarios, Sustainable Development Scenario (SDS), Stated Policy Scenario (STEPS) and Current Policy Scenario (CPS). Each scenario expects a certain level of carbon budget and temperature increase in 2050. Each scenario is tied to a carbon budget. A carbon budget specifies the amount of fossil carbon that can be combusted worldwide to remain within a certain temperature. The carbon budget changes depending on scenario. For example, to remain within the limits of the SDS, less carbon can be combusted compared to the scenarios that expect a significant temperature increase i.e. the CPS. The Sub-Fund relies on the Sustainable Development Scenario pathway which is fully aligned with the Paris Agreement by holding the rise in global temperatures to “well below 2°C and pursuing efforts to limit it to 1.5°C”. The approach is in line with the expectations of the Commission Delegated Regulation (EU) 2020/1818 in terms of GHG scopes, calculations and trajectories methodologies. In addition, as part of its social sustainable investment objective, the Sub-Fund invests in companies contributing positively to social solutions. To define the sustainable investment universe, a “pass-fail” approach is used using a set of criteria. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the sustainable objectives followed by the Sub-Fund.

### ● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The analysis of certain sustainability indicators is systematically integrated into the investment decision making process. The attainment of the sustainable investment objectives is assessed by investing in securities financing economic activities that substantially contribute to the environmental and/or social objectives mentioned above. To define the sustainable investment universe, a “pass-fail” approach using a set of criteria. No other criteria than the ones mentioned below are used to define the sustainable investment nature of an investment. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe.

To be eligible to the investment universe, the Management Company uses the below criteria:

- o Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed Science Based Target (SBT)", or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets.
- o Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
- o Having a net positive aggregated Overall SDG Score by reference to the Sustainable Development Goals. The criterion is sourced from the external data provider ISS. This criterion assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer's product portfolio on the achievement of sustainability objectives. For corporate issuers the SDG Solutions Score considers only the most distinct objectives scores, i.e., the highest positive

**Sustainability indicators** measure how the sustainable objectives of this financial product are attained.

## ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solutions Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.

- o Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of these criteria or (ii) a differentiated view of the company's impact assessment leveraging the External Investment Manager's proprietary methodology.

### ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

The "Do No Significant Harm" (DNSH) principle is compiled by taking into account adverse impacts indicators listed in the Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022. The Sub-Fund takes into consideration (for some of them using proxies) all the mandatory adverse impact indicators listed in Table 1 of Annex 1 that are applicable to investee companies.

In addition, the Sub-Fund takes into consideration PAI No. 4 in Table 2 of Annex 2, applicable to investee companies, relating to investments in companies without carbon reduction initiatives. The Sub-Fund also takes into consideration PAI No. 15 of Table 3 of Annex 1, applicable to investee companies, relating to the lack of anti-corruption and anti-bribery policies.

### ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

The Sub-Fund considers adverse impacts of its investments on society and the environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusions of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator "investing in companies without carbon emission reduction initiatives" (i.e., PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the optional indicator "lack of anti-corruption and anti-bribery policies" (i.e. PAI 15) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.



## ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

### *How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:*

The Sub-Fund's sustainable investments are aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights, including the principles and rights set forth in the 8 "fundamental" conventions identified in the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work (covering subjects considered to be fundamental principles and rights at work, e.g., freedom of association and the right to collective bargaining, the elimination of all forms of forced or compulsory labour, the effective abolition of child labour, and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation) and the International Bill of Human Rights.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers adverse impacts of its investments on society and the environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusion of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 and 16 in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators:

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator "investing in companies without carbon emission reduction initiatives" (i.e., PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the optional indicator "lack of anti-corruption and anti-bribery policies" (i.e. PAI 15) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

### What investment strategy does this financial product follow?

The portfolio will seek to have exposure to issuers exposed to four long-term sustainable themes, namely education, health and wellbeing, social infrastructure and sustainable solutions.

The external investment manager investment philosophy is founded on the understanding that performance and principles are inseparable when seeking to create long-term investment returns for clients. The external investment manager believes consistent, long-term returns are more likely to be achieved by investing responsibly in sustainable businesses. The Sub-Fund follows an active, long term, value orientated investment

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

philosophy identifying companies which are trading at attractive valuation levels using a variety of different metrics.

The external investment manager pursues an integrated approach whereby the investment and SRI cases of any stock idea are considered together. The initial investment universe is composed of all large and mid-cap stocks listed in developed European countries. The relatively strict ESG criteria are an important element in defining the external investment manager's final investment universe. The external investment manager applies both negative and positive screenings.

The external investment manager's in-house responsible investment experts undertake an in-depth analysis of the risk factors most applicable to the company and the sector, using a variety of sources, including company produced reports, market knowledge, and third-party research. The external investment manager aims to identify companies with a well-developed approach to ESG risk management. All investments undergo an ESG/Responsibility review, which considers six areas of business risk (i.e., environment and climate change, business ethics, community, employment and labour, human rights and corporate governance). The external investment manager seeks to see positive direction in all six ESG areas over a 3–5-year period.

As part of the process, the external investment manager embraces 4 themes (i.e., education, health and well-being, social infrastructure, and sustainable solutions) that consider positive impacts. Within the sustainable solutions theme, the Sub-Fund seeks to achieve positive environmental impact by investing primarily in companies that are leading the way to a zero-carbon economy and have either an approved SBTi emissions reduction plan, an ambitious carbon reduction plan, are working towards a carbon reduction plan or offer solutions that contribute to a zero-carbon economy. Sustainability is seen as a key "locomotive for change" in investment decision making. Engagement is an important part of the investment process. The External investment Manager engages with investee companies on various ESG topics directly, in collaboration with its peers, and through initiatives. EdenTree engages in long-term as well as in shorter-term tactical engagements.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies non-compliant with SFDR Sustainable Investments mandatory norms and conventions	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%

## ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>5%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>5%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis as defined by the ESG/responsibility review of the External investment Manager. All investments undergo an ESG/Responsibility review, which considers six areas of business risk (i.e., business ethics, community, corporate governance, employment and labour, environment and climate change, human rights). The external investment manager seeks to see positive direction in all six ESG areas over a 3–5-year period. All companies failing in meeting the External Investment Manager’s ESG/responsibility review are excluded from the investment universe.
- Sustainable investment eligibility criteria (the below criteria may not be cumulative):
  - Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed Science Based Target (SBT)", or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets.
  - Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
  - Having a net positive aggregated Overall SDG Score by reference to the Sustainable Development Goals. The criterion is sourced from the external data provider ISS. This criterion assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer’s product portfolio on the achievement of sustainability objectives. For corporate issuers the SDG

## ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Solutions Score considers only the most distinct objectives scores, i.e., the highest positive and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solutions Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.

- Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of these criteria or (ii) a differentiated view of the company's impact assessment leveraging the External Investment Manager's proprietary methodology.

● **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.

## ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

The external investment manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. This external investment manager assesses prospective investments for issues relating but not limited to ownership and control, board structure, board diversity, pay practices, accounting and tax practices, political and lobbying practices, and stakeholder engagement.

The external investment manager reviews policies, such as codes of conduct and anti-bribery and corruption policies, as well as compliance infrastructure to assess governance practices. The external investment manager examines the history and pattern of corporate behaviour going back five years and assesses remediation of governance controversies.



### What is the asset allocation and the minimum share of sustainable investments?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the sustainable investment process in place, hence in investments that are defined as sustainable (#1 Sustainable). The external investment manager’s proprietary sustainable analysis covers 100% of the “#1 Sustainable” investments. “#1 Sustainable” investments include a minimum of 50% assets with environmental objectives and 25% with social objectives. Investments with environmental objectives are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy.

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Not Sustainable). “#2 Not Sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging purpose as a technique of portfolio management efficiency. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.

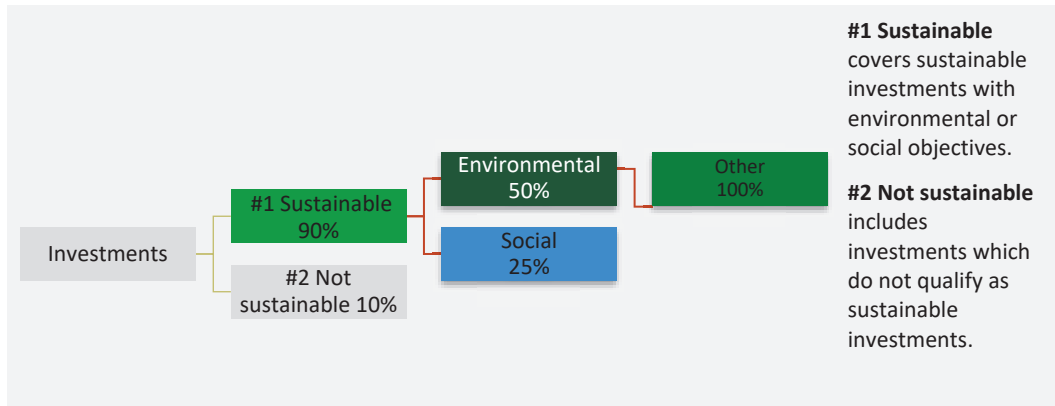
**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

## ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee



**#1 Sustainable** covers sustainable investments with environmental or social objectives.

**#2 Not sustainable** includes investments which do not qualify as sustainable investments.

- **How does the use of derivatives attain the sustainable investment objective?**  
Not Applicable



### To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund's sustainable investments with an environmental objective are not aligned with the EU taxonomy (i.e. 0%) as the investments with an environmental objective are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU taxonomy.

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

- Yes:
- In fossil gas     In nuclear energy
- No

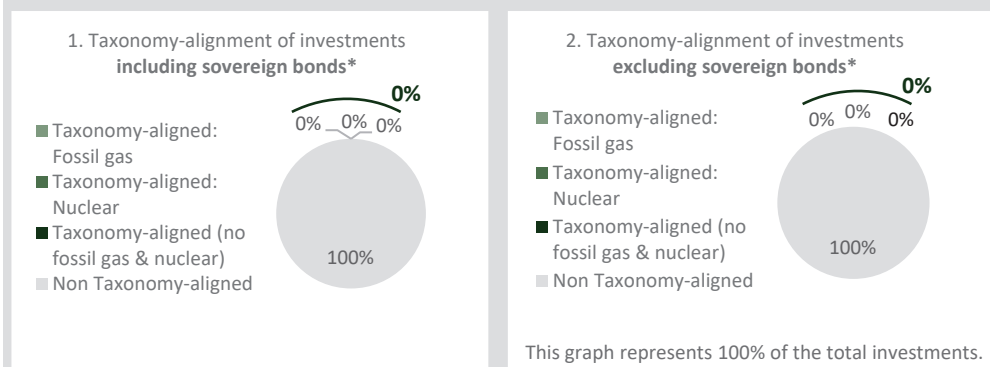
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy is 100%. The Sub-Fund commits to make a minimum of 50% sustainable investments with an environmental objective not aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund commits to make a 25% minimum share of sustainable investments with a social objective.



### What investments are included under “#2 Not sustainable”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Not Sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging purpose as a technique of portfolio management efficiency. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.

## ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Is a specific index designated as a reference benchmark to meet the sustainable investment objective?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How does the reference benchmark take into account sustainability factors in a way that is continuously aligned with the sustainable investment objective?***  
Not Applicable
- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***  
Not Applicable
- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***  
Not Applicable
- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***  
Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>



## ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities

**Legal entity identifier:**

549300THMKO6BNKMKF82

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary.

## ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

## ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

**How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

**How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



**Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?**

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

## ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%

## ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU)2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

The delegated external investment managers selected by the Management Company are committed to apply a selectivity rate of at least 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

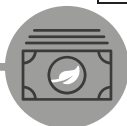
**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

## ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

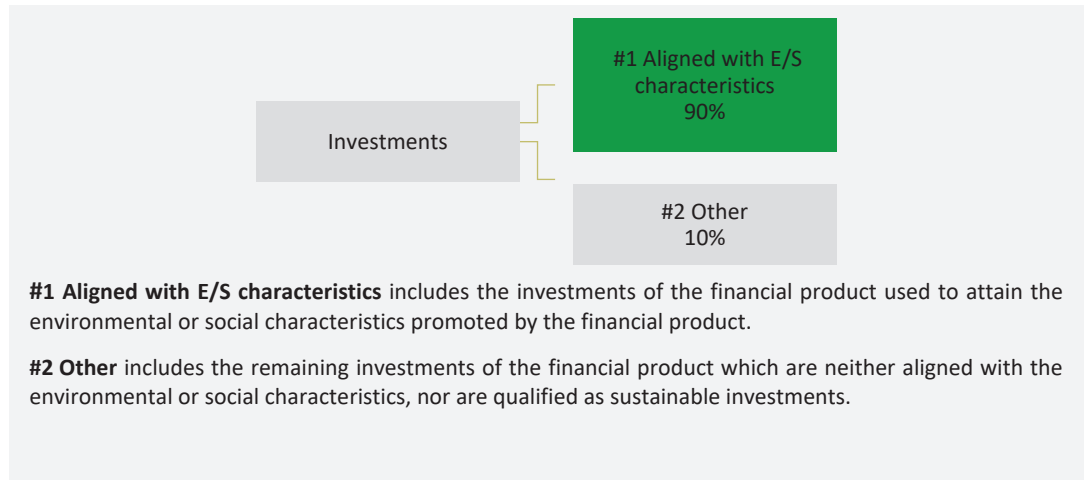
**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

## ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

- Yes:
- In fossil gas  In nuclear energy
- No

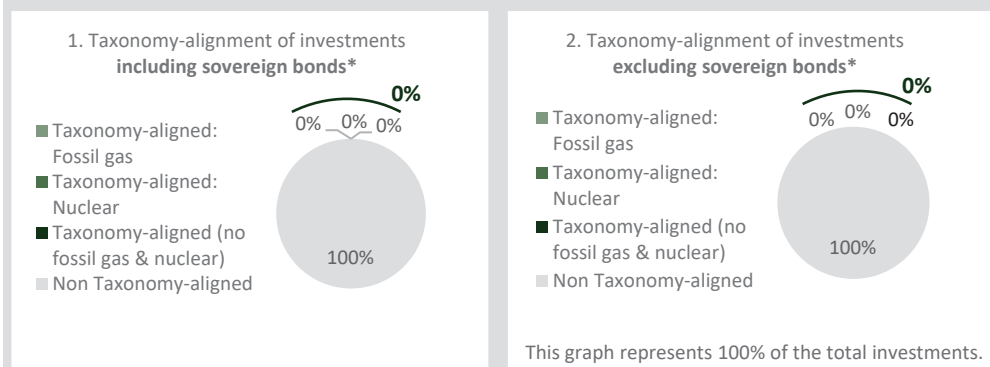
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



## ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?**

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



**Where can I find more product specific information online?**

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html)  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- [Documents of the Sub-Fund:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html)  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Global ESG Equities

**Legal entity identifier:**

5493004T2JKIP24WRQ57

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Global ESG Equities (the “Sub-Fund”). ESG integration is defined as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are leading in ESG best-practice.

## ABN AMRO Funds Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

## ABN AMRO Funds Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

**How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

**How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



**Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?**

Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

## ABN AMRO Funds Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What investment strategy does this financial product follow?

To select eligible securities, the Management Company performs both a financial and non-financial analysis, using ESG criteria in combination with exclusions filters. The Sub-Fund will be composed of issuers that are leading in ESG best-practice. The eligible universe is determined by the combination of exclusion filters and selectivity approach based on ESG data from Sustainalytics as set out below.

- Exclusion filters: the purpose of these filters is to exclude companies and activities that might have a negative effect on society and environment or human rights (activities and norm-based exclusions). On this basis are excluded certain controversial activities such as but not limited to weapons production, tobacco producers and sellers, GMOs, gambling, adult entertainment, cannabis for recreational purpose, arctic drilling, shale gas, oil sands, coal mining, fur and specialty leather, etc. (subject to certain revenue thresholds). Based on international norms violation, companies involved in serious human rights injuries and environmental damage are also excluded.
- ESG best-in-class approach or positive screening: the Management Company identifies companies that manage their ESG risk better than their peer group within the Top 50th percentile of the sub-industry peer group (Sustainalytics' assessment of a company's ESG Risk Score relative to a Sustainalytics' subindustry, expressed as a percentage rank, with 1% representing the company with the lowest ESG Risk Score and 100% the company with the highest ESG Risk Score in the subindustry). Moreover, the Sub-Fund will not invest in companies whose controversy score is above certain thresholds: level 4 and 5 are not allowed (within a scale from 0 to 5 where: 0 is No controversy, 1 is Low, 2 is Moderate, 3 is Significant, 4 is High, and 5 is Severe).

The Management Company then performs further analysis to consider the valuation of these companies and the appropriate time to purchase in consideration of the Fund's financial objective.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
<b>Company Exclusions based on Revenue Thresholds</b>	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The companies with the top 50% ESG risk scores in their sub-industry peer groups and with a controversy score below 4 are considered for inclusion in the portfolio.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

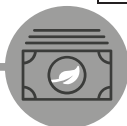
**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

## ABN AMRO Funds Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

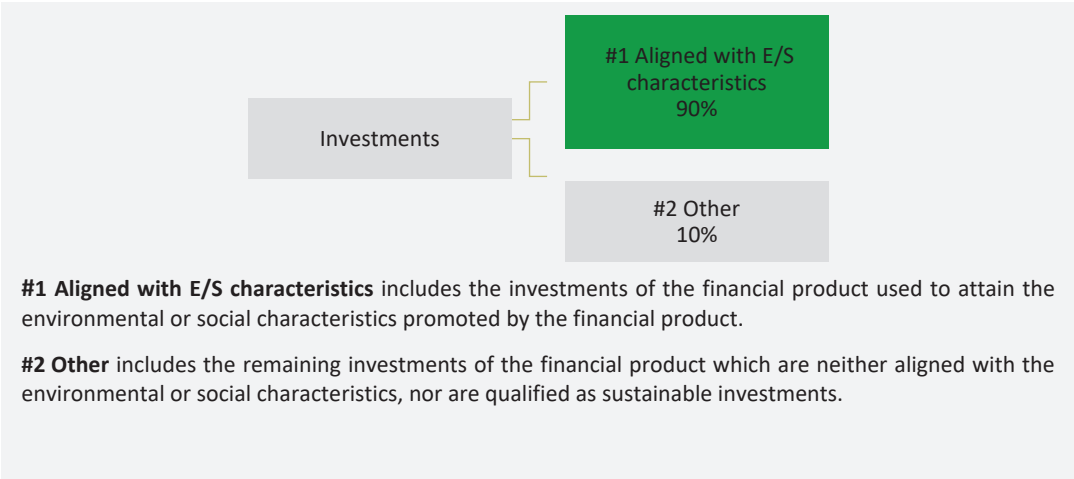
**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

## ABN AMRO Funds Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

Yes:

In fossil gas     In nuclear energy

No

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

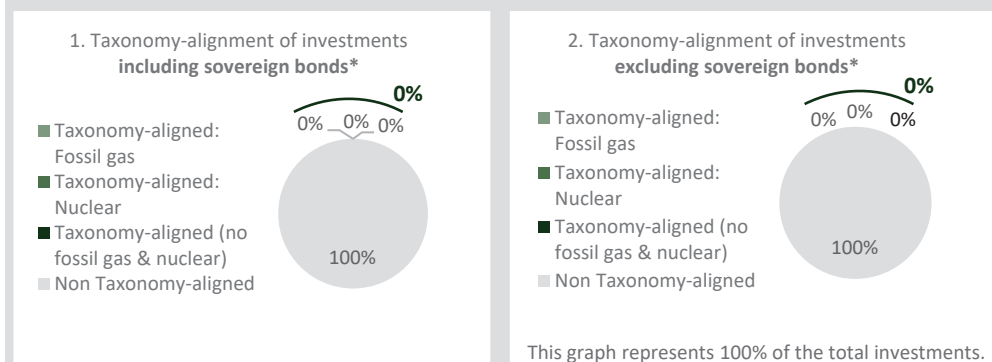
<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.



## ABN AMRO Funds Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### ● What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

## ABN AMRO Funds Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

**Legal entity identifier:**

549300LCUAZBZWYABN92

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Manager must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall sustainability strengths going from the

## ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights and labour standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

## ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, it strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

## ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

The External Investment Manager believes that the transition to a more sustainable global economy provides a helpful backdrop to construct high conviction, low turnover equity portfolios that are well positioned to achieve long term capital growth. The Sub-Fund seeks to invest in companies with sustainable competitive advantages that are positioned to achieve high or improving returns over the investment horizon.

The External Investment Manager combines its “sustainability lens” and its “systematic ESG rating” analysis to select companies with long-term opportunities in sectors that are less exposed to disruption and risk.

First, the “sustainability lens” helps to assess ESG risks as well as opportunities by identifying sub-sectors well positioned for the transition to a more sustainable economy as well as those that present risks within this transition.

Sub-industries are measured against 9 risks:

- Company
  - o Health & Safety Vulnerability
  - o Labour Constraints
  - o Pollution & Waste Externalities
- Stakeholders
  - o Supply Chain Dependency
  - o Product Liabilities (including Cybersecurity)
  - o Bribery & Corruption
- Wider Landscape
  - o Natural Resources & Biodiversity
  - o Climate Change
  - o Anti-trust Regulations

The “sustainability lens” analysis results in ranking companies on a 3 scale level (i.e. high, neutral and low).

Then, the External Investment Manager’s “systematic ESG Rating” which is used in this Sub-Fund combines multiple sources of third-party ESG data with original research and analysis. This systematic scoring system provides a proprietary ranking of companies’ ESG performance versus sector peers, scoring Russell 1000 companies on a scale of 0-10 .

This scoring includes consideration of

- Over 180 key ESG indicators
- Original security research
- Impax Gender indicator
- Impax Carbon Intensity indicator
- How exposed is the company to material ESG risks?
- How can the company take advantage of ESG opportunities?
- Assigns weights for indicators, tailored by industry
- ESG momentum adjustment – taking into account progress or regression in a company’s ESG profile

## ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ESG controversy scoring adjustment

Lastly, the External Investment Manager assesses the ideas generated by the Sustainability Lens and the Systematic ESG score model using the External Investment Manager’s 10- Step analysis. This 10-Step analysis includes an in-depth ESG analysis and covers

- Environmental, Social and Governance (ESG) processes, performance, and policies in place and the level of disclosure of these.
- Structure and effectiveness of the Board.
- Shareholder friendliness and the protection of shareholder rights.
- Ownership structure and control issues.
- Compensation and incentive structures, alignment with shareholder long term interests and level of disclosure.
- Corporate behaviour, reputation, and integrity.

Following completion of the analysis, each company is categorized by the External Investment Manager’s dedicated ESG analyst into one of the following:

- Excellent
- Good
- Average
- Fair
- Excluded

Companies categorized as ‘Excluded’ are not eligible for investment, while those categorized as ‘Fair’ have a cap for allowed weighting within the portfolio.

Methodological limitations can be assessed in terms of nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company’s exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact’s Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%

## ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will exclude fossil fuel (i.e., thermal coal, oil and gas) related investments as follows: exploration & production and refining & processing:
  - Companies with >0% revenue or profits (defined as EBIT, EBITA or EBITDA) derived from direct fossil fuel activities identified above (i.e., exploration & production and refining & processing) will be excluded from Sub-Fund's portfolio.
  - Companies with >5% revenue or profits (defined as EBIT, EBITA or EBITDA) derived from direct storage and distribution activities will ordinarily be excluded from the Sub-Fund's portfolio, although companies may be included in the portfolio if a company has established itself as a leader in the transition to a zero-emissions energy economy with reduction targets, including GHG Emissions - Scope 1, GHG Emissions - Scope 2, and GHG Emissions - Scope 3, that are compatible with the Paris Agreement's target of limiting future warming to 2°C, and has agreed to publicly report on progress.
  - Companies with >5% revenue or profits (defined as EBIT, EBITA or EBITDA) derived from the above power generation sector will ordinarily be excluded from the Sub-Fund's portfolio, although companies may be included in the portfolio if a company has established itself as a leader in the transition to a zero-emissions energy economy with reduction targets, including Scope 1, Scope 2, and Scope 3, compatible with the Paris Agreement's target of limiting future warming to 2°C, and has agreed to publicly report on progress.
- Exclusion of the companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. The External Investment Manager considers for inclusion in the portfolio companies which score 5 or above, as ranked by the external investment manager ESG Rating. ESG laggards (score of <2.5) are excluded from the universe.



## ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

- **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

## ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

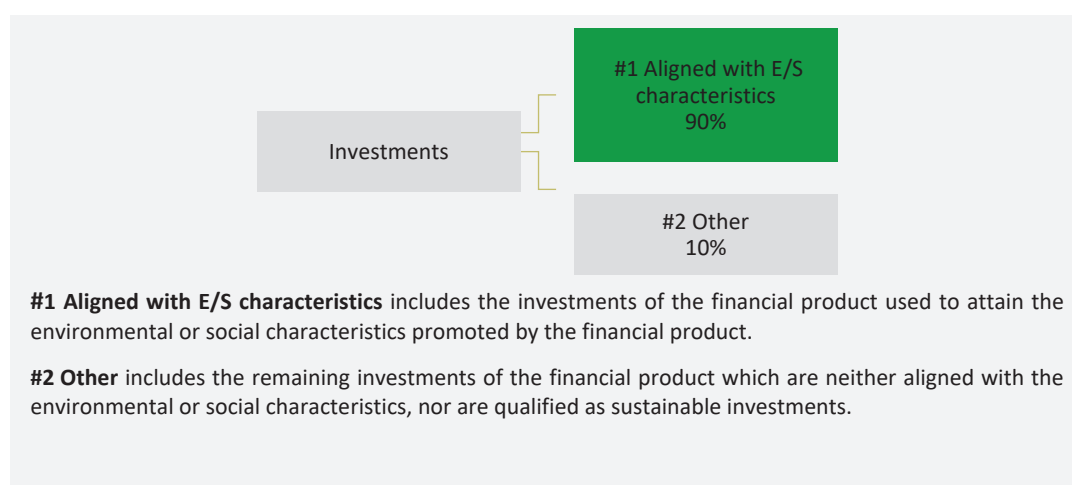


**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

## ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

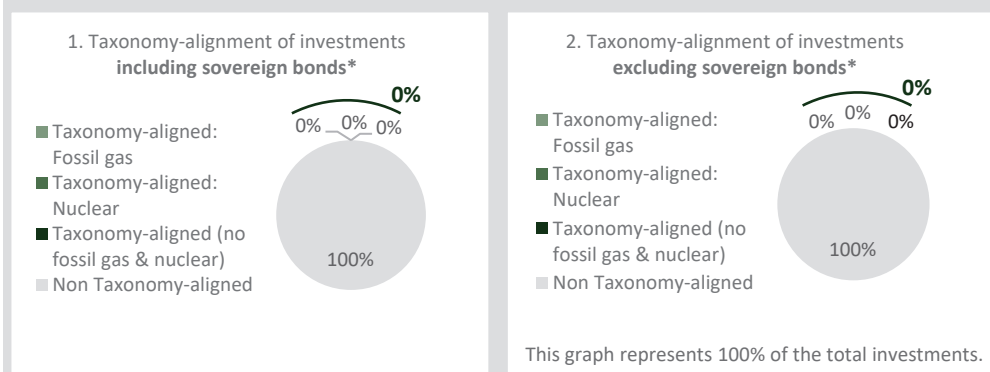
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

- Yes:
- In fossil gas     In nuclear energy
- No

*The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



**What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable



**What is the minimum share of socially sustainable investments?**

Not Applicable

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>

- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds

**Legal entity identifier:**

549300GRK0RJWQG5TW54

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

## ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

## ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

## ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

The External Investment Manager's approach starts by defining an ESG optimised investment universe, whereby issuers deemed unsustainable (as further described) are excluded. At this stage, the bottom 40% of issuers within the global universe are being removed. Within the optimised universe, the External Investment Manager selects securities based on financial criteria, as well as ESG criteria. Each issuer is evaluated through fundamental credit analysis and receives the External Investment Manager's own proprietary risk centric ESG ratings. Issuers with an ESG rating of 3.6 or worse fall within the 40th percentile threshold (ratings are from 1 to 5, 1 being the best and 5 being the worst score). Any issuers with ratings worse than 3.6 (means: over 3.6) will need to have a positive ESG momentum score (explained below), indicating that the company is on an improving ESG trajectory, to be considered for investment.

The ESG analysis is a quantitative framework that effectively integrates the External Investment Manager's analysts' research, and supplemented with data from multiple third-party data providers, generates an ESG rating and momentum signal for a wide range of entities. The External Investment Manager incorporates raw ESG data from four full ESG datasets namely: MSCI, Sustainalytics, VigeoEiris, and CDP climate change & water metrics. The External Investment Manager also uses the Bloomberg legal entities references for credit risk datasets to map the ESG records to all issuers within a credit risk tree. Raw data from these data providers is then mapped and assigned global company identifiers and ultimate parent identifiers before being added to the External Investment Manager ESG database. Each metric that contributes to an issuer's ESG rating has two key elements (i) a score - evaluating an issuer's performance in that metric (ii) a weight -evaluating the materiality of the metric to the issuer.

Both datasets are then mapped to one or more ESG 'pillars' as set out below; these have different weights depending on the issuer's industry. To generate a weight and a score at key-issue level, the External Investment Manager combines inputs from the credit analysts together with third-party averages. The analysts' views on the materiality of key issues facing each industry group are merged with views of the data providers, and the values are averaged. To ensure the External Investment Manager ESG ratings are based on good data coverage, the External Investment Manager includes only records which (i) have data under each E, S and G pillar, which are based on (ii) five distinct data points and (iii) have more than five distinct data provider fields. This scoring methodology produces two separate ratings for every issuer: an overall ESG rating and a momentum signal. The overall ESG rating is designed to indicate an issuer's performance relative to its peers. The External Investment Manager calculates each issuer's percentile based on the raw ESG ratings within each Global Industry Classification Standard (GICS) industry group and assign the final ESG rating (between 1 and 5, where 1 is the best score and 5 the worst). The momentum signal considers the most recent five years of headline ESG scores and determines an average year-on-year change, weighted towards the most recent data. Based on this data, a momentum score from -2 to 2 is assigned.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).



## ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. The Sub-Fund focuses on companies which score 3.6 or below, as ranked by the External investment Manager (the lower score, the better). Companies which score over 3.6 can be invested if the ESG momentum score is positive as assessed by the external Investment Manager, indicating that the company is on an improving ESG trajectory.

## ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

- **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

## ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

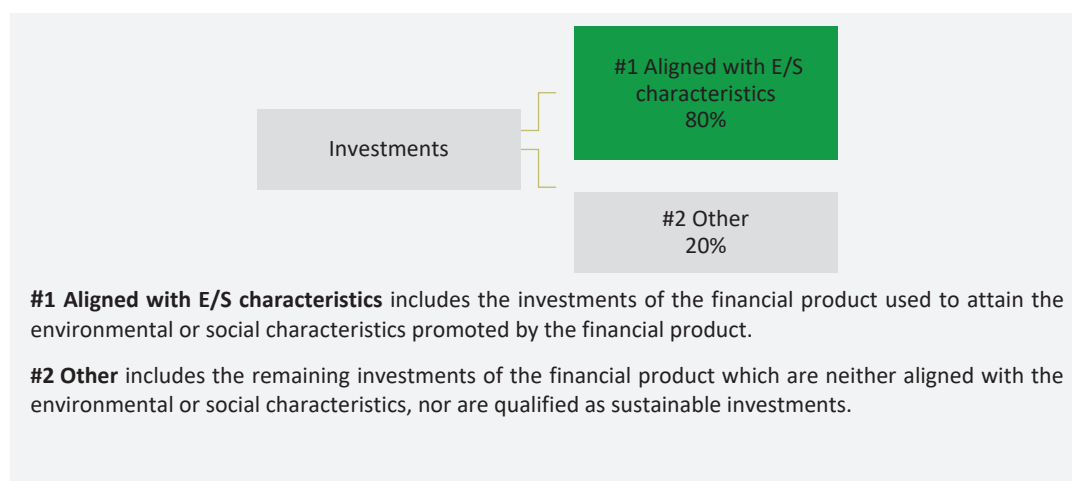
### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



### To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

## ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds

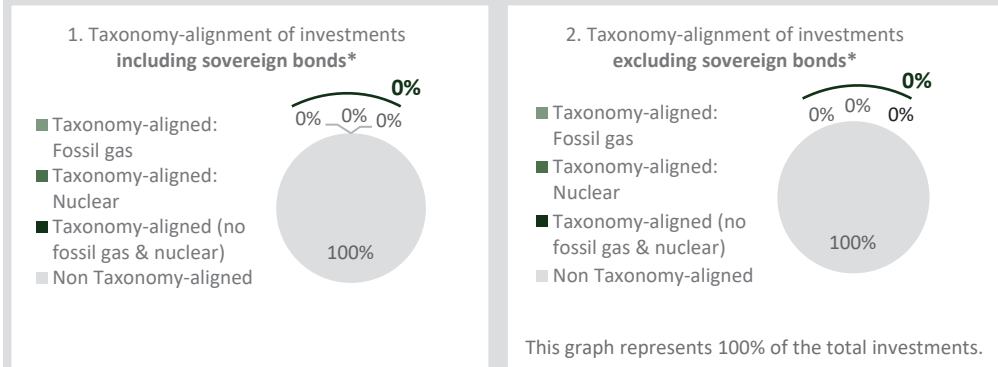
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

- Yes:
  - In fossil gas
  - In nuclear energy
- No

*The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



**What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable



**What is the minimum share of socially sustainable investments?**

Not Applicable

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged

**Legal entity identifier:**

549300SJ3V951NBLB873

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

### Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

## ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

## ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



## ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

The External Investment Manager's approach starts by defining an ESG optimised investment universe, whereby issuers deemed unsustainable (as further described) are excluded. At this stage, the bottom 40% of issuers within the global universe are being removed. Within the optimised universe, the External Investment Manager selects securities based on financial criteria, as well as ESG criteria. Each issuer is evaluated through fundamental credit analysis and receives the External Investment Manager's own proprietary risk centric ESG ratings. Issuers with an ESG rating of 3.6 or worse fall within the 40th percentile threshold (ratings are from 1 to 5, 1 being the best and 5 being the worst score). Any issuers with ratings worse than 3.6 (means: over 3.6) will need to have a positive ESG momentum score (explained below), indicating that the company is on an improving ESG trajectory, to be considered for investment.

The ESG analysis is a quantitative framework that effectively integrates the External Investment Manager's analysts' research, and supplemented with data from multiple third-party data providers, generates an ESG rating and momentum signal for a wide range of entities. The External Investment Manager incorporates raw ESG data from four full ESG datasets namely: MSCI, Sustainalytics, VigeoEiris, and CDP climate change & water metrics. The External Investment Manager also uses the Bloomberg legal entities references for credit risk datasets to map the ESG records to all issuers within a credit risk tree. Raw data from these data providers is then mapped and assigned global company identifiers and ultimate parent identifiers before being added to the External Investment Manager ESG database. Each metric that contributes to an issuer's ESG rating has two key elements (i) a score - evaluating an issuer's performance in that metric (ii) a weight -evaluating the materiality of the metric to the issuer.

Both datasets are then mapped to one or more ESG 'pillars' as set out below; these have different weights depending on the issuer's industry. To generate a weight and a score at key-issue level, the External Investment Manager combines inputs from the credit analysts together with third-party averages. The analysts' views on the materiality of key issues facing each industry group are merged with views of the data providers, and the values are averaged. To ensure the External Investment Manager ESG ratings are based on good data coverage, the External Investment Manager includes only records which (i) have data under each E, S and G pillar, which are based on (ii) five distinct data points and (iii) have more than five distinct data provider fields. This scoring methodology produces two separate ratings for every issuer: an overall ESG rating and a momentum signal. The overall ESG rating is designed to indicate an issuer's performance relative to its peers. The External Investment Manager calculates each issuer's percentile based on the raw ESG ratings within each Global Industry Classification Standard (GICS) industry group and assign the final ESG rating (between 1 and 5, where 1 is the best score and 5 the worst). The momentum signal considers the most recent five years of headline ESG scores and determines an average year-on-year change, weighted towards the most recent data. Based on this data, a momentum score from -2 to 2 is assigned.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

For information, the Sub-Fund will aim to lower the duration by an equivalent of the duration of its Reference Portfolio using listed derivatives.

## ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. The Sub-Fund focuses on companies which score 3.6 or below, as ranked by the External investment Manager (the lower score, the better). Companies which score over 3.6 can be invested if the ESG momentum score is positive as assessed by the external Investment Manager, indicating that the company is on an improving ESG trajectory.

## ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

- **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

## ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

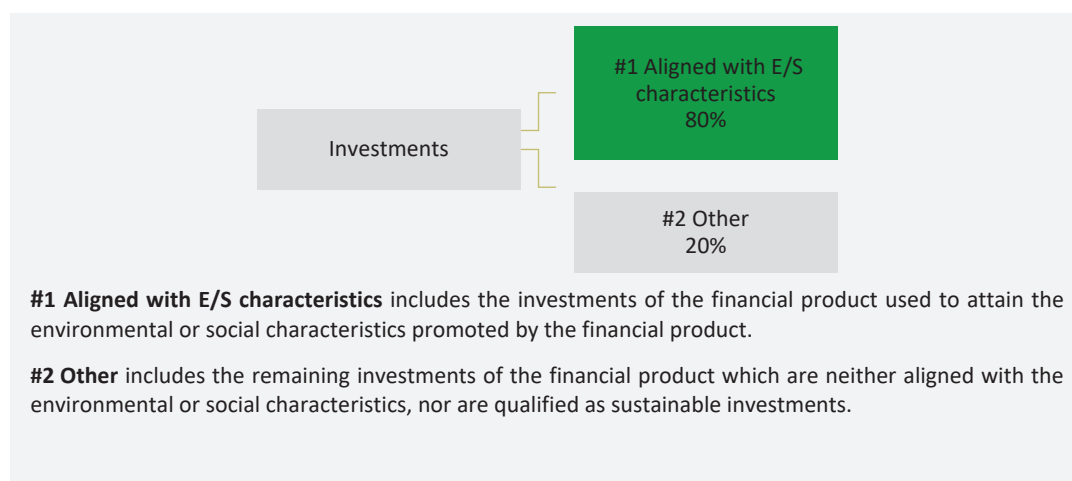
### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



### To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

## ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged

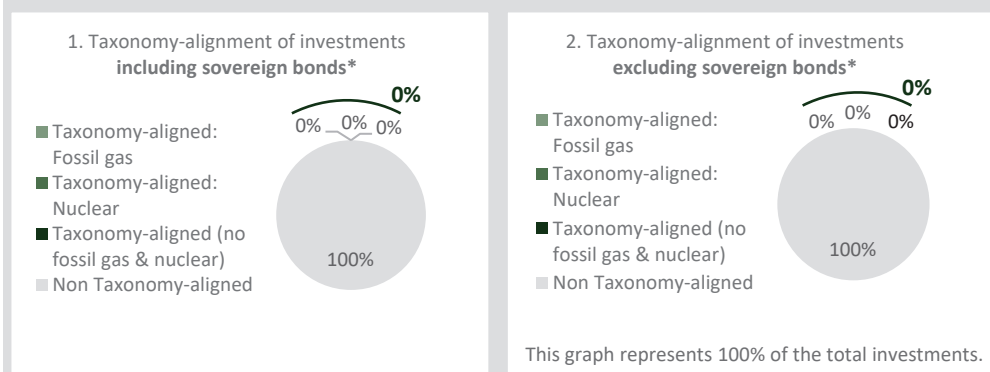
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

### Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?

- Yes:
- In fossil gas  In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

**Legal entity identifier:**

63670019066TV61K1P05

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities (the “Sub-Fund”). The External Investment Manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Manager must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

## ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk mitigation management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-



## ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.

- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

— ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

— ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

## ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund aims to provide medium term capital growth with a diversified and actively managed portfolio of Asia Pacific market equities. The Sub-Fund is actively managed through a fundamental and bottom-up stock selection process while seeking to identify high quality companies with superior and sustainable growth potential. The External Investment Manager integrates ESG aspects to identify companies with strong or improving sustainability characteristics and that are leading in ESG practices.

In-depth fundamental research is conducted on companies in the Pacific Developed region by research analysts. The External Investment Manager in-depth analyses are captured in the Strategic Classification. The objective of the Strategic Classification is to answer a simple question: "Is this a business we want to own?". The Strategic Classification takes an exhaustive look at:

- **Economics:** In order to understand economic returns, the External Investment Manager needs to consider all of the factors that influence the amount of capital needed to run a business, the profits it makes by employing this capital, and the amount of capital that can be re-invested. These factors can be external to the company (macro and industry), or specific to it (company and management).
- **Duration:** A company's ability to sustain returns depends on a wide variety of factors: to have confidence in a company's duration, the External Investment Manager needs to consider the potential impact on the business of several risk factors, including macro, industry and company factors, as well as management choices.
- **Governance:** Many different factors influence the External Investment Manager view of governance. They can be approached in two ways (i) by source (macro/industry/company/management) and (ii) by cause (competence and motives).

Following the analysis of these variables, the analyst will assign one of the four Strategic Classifications to a company (i) Premium (ii) Quality (iii) Trading (iv) Structurally Challenged. The strategy has a clear preference for Premium and Quality companies. The analysts also complete the EMAP Checklist and Materiality Framework for every company to assess the

## ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

risks associated with the business. The EMAP Checklist is a near-100 question survey completed for every company covered, with the primary goal of identifying the key risks associated with the company. ESG considerations are formally addressed through 40 question ESG Checklist. The 40 questions are a globally consistent subset of the near-100 question survey. The checklist includes both negative and positive questions, as well as a severity assessment. The EMAP Checklist is not a “pass/fail” exercise. Rather, it is a tool to inform discussions between portfolio managers and analysts and an important driver behind the engagement with the companies covered. The overall assessment influences the Strategic Classifications. The Materiality Framework is a proprietary tool used to score companies on the ESG issues that are relevant to the sub-industry in which they operate. Analysts consider the five most financially material ESG risks (as identified by the analysts) in over 50 sub-industries and companies are rated 1 to 5 on each of those five risk factors. For example, issues around pollution would be material for a commodity company but immaterial to a software company (where instead issues like data protection would be more material). The 1-5 scoring system reflects a desire to differentiate between leaders and laggards, and to do so in a way which emphasizes judgement over data gathering. The Materiality Framework serves as a roadmap for more specific engagement with companies.

Having understood the opportunity and risks around a company, the research analysts then value that opportunity through a valuation framework analysis.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company’s exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact’s Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%

## ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Exclusion of the companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. The External Investment Manager excludes the worst quintile of stocks based on their internal ESG score driven by the EMAP Checklist, a nearly 100-question sustainability checklist, to filter out the “worst offenders” not previously excluded. The companies are ranked by how many red flags they have on the EMAP Checklist and then the bottom quintile is excluded. The higher the number of red flags the worse the ESG score

- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

- ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

## ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

The External Investment Manager attempts to outline a complete set of considerations on Governance in the EMAP Checklist for every company under coverage. In the checklist of questions, Governance is analysed through an appraisal of management in specific areas of activity: (i) Attitudes & skill set (ii) Track record & consistency (iii) Financing the business (iv) Financial transparency & dividends (v) Short termism & motives (vi) Ownership Factors. Governance is covered in detail in the Strategic Classification of a company. In this in-depth analysis the External Investment Manager looks to appraise whether the company's returns will accrue to shareholders in full, or be impaired by poor governance. Finally, governance considerations are also covered in the Materiality Framework, with the focus varying depending on which issues are most financially material to the sub-industry.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

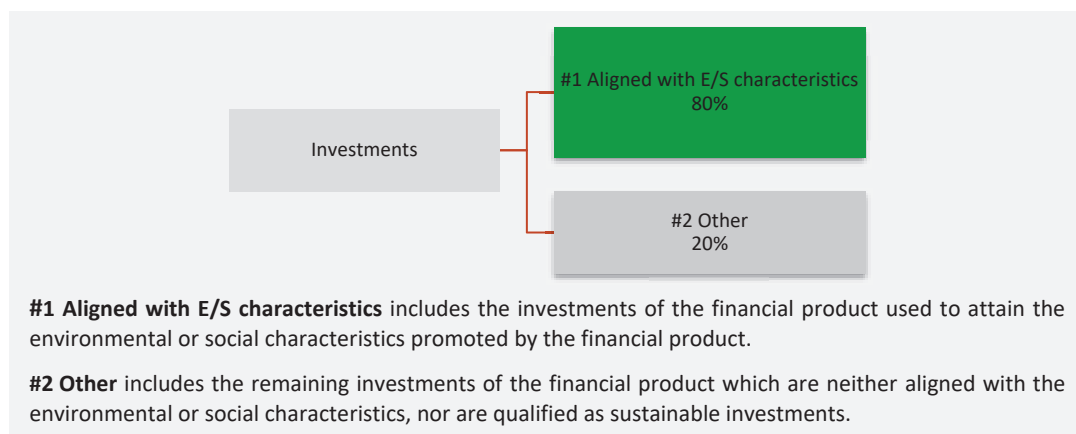
**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

## ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

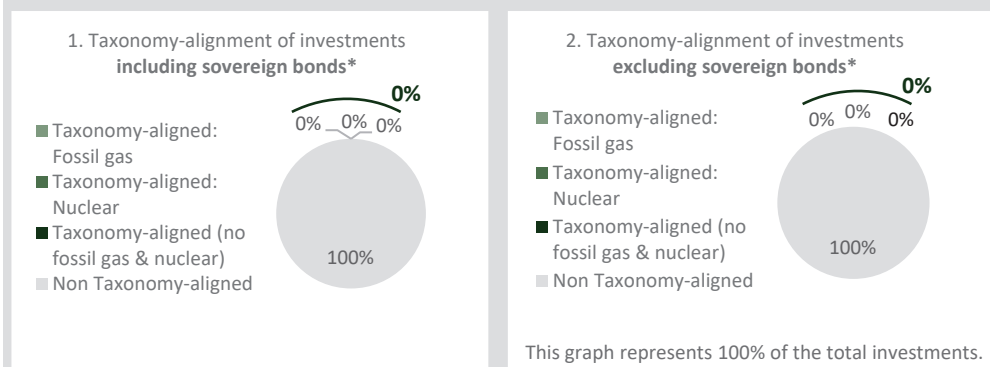
- Yes:
- In fossil gas  In nuclear energy
- No

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

## ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?**

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



**Where can I find more product specific information online?**

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.



## ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds

**Legal entity identifier:**

5493003UDGYSKOEU0584

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall sustainability strengths going from the

## ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

## ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

## ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria.

The External Investment Manager's approach is based on three pillars:

- exclusion & avoidance,
- integration: in the investment process the external investment manager assesses the ESG profile of a company. The external investment manager takes into account material risks in a given industry in combination with the company's respective risk exposure, practices and disclosure. Furthermore, the external investment manager looks into the company's exposure to past controversies and future ESG opportunities. A low score on ESG criteria can result in the demand for an additional premium on the company's bonds and/or initiation of an engagement with the issuer. If ESG risks are deemed too severe, an investment in the company will be avoided and/or existing holdings will be sold
- Engagement: As active long-term investors, the external investment manager performs comprehensive engagements with portfolio companies with the objective to unlock value and reduce risk. The external investment manager engagement process defines clear objectives of which the progress and result is tracked and well documented. If at any stage the company refuses to cooperate, divestment has to be considered.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>35%
Thermal Coal Extraction	>10%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Tobacco Producing Companies	>0%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Exclusion of the companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. The External Investment Manager considers for

## ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

inclusion in the portfolio companies which score CCC or above and taking the external data provider MSCI ESG.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.

## ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

The External Investment Manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. The External Investment Manager utilises its UN Global Compact Exclusion process and resulting list. The Stewardship and Sustainability team and UN Global Compact Committee of the external investment manager (including representatives from all asset classes) are responsible for the ongoing monitoring and oversight of said exclusion list, and assess individual companies and cases via 7 key principles in order to determine status. These are: pattern of behaviour, legitimacy, assurance, engagement, duration and extent of behaviour. As inputs to the research process, the external investment manager uses third-party ESG data vendors alongside company disclosures and news.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

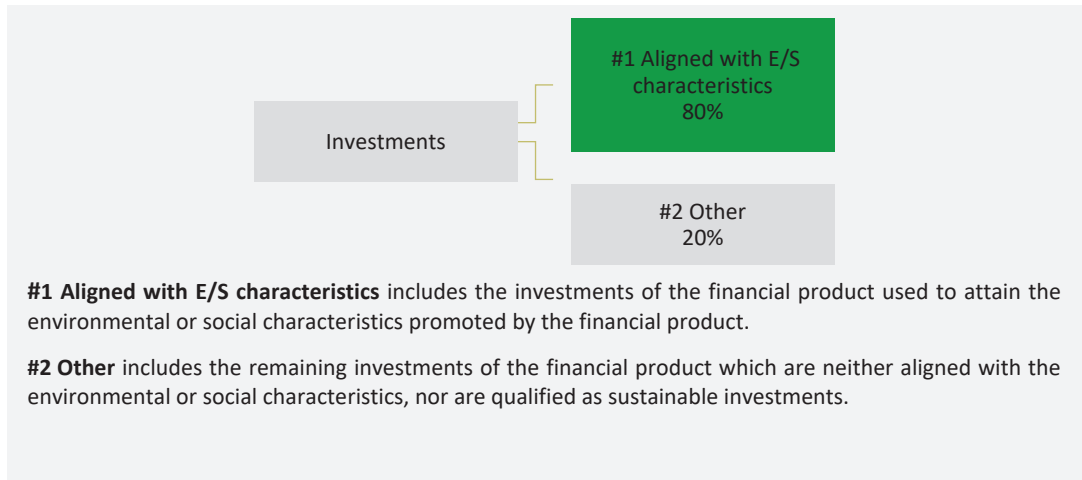
**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

## ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



**To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>2</sup>?**

- Yes:
- In fossil gas     In nuclear energy
- No

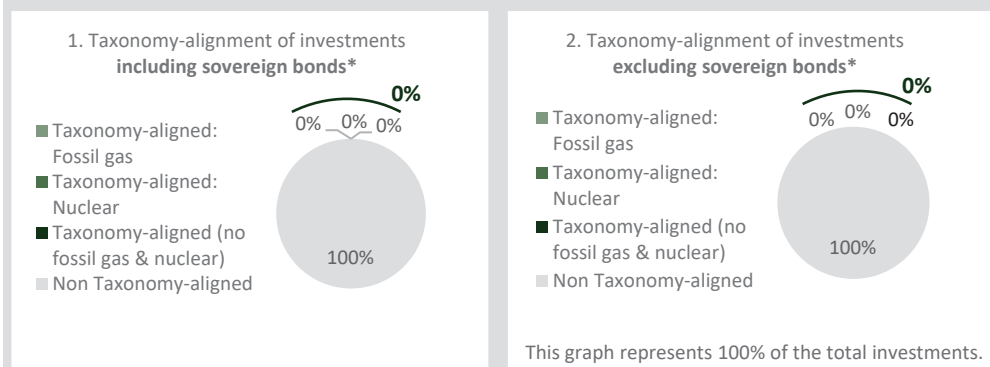
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

<sup>2</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



## ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?**

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



**Where can I find more product specific information online?**

*More product-specific information can be found on the websites:*

- *ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:*  
*<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abnamro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>*

- *Documents of the Sub-Fund:*  
*<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>*

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

### Product name:

ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

### Legal entity identifier:

5493009C88PY6WDG4J06

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

### Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall sustainability strengths going from the

## ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

## ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

## ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria.

The External Investment Manager's approach is based on three pillars:

- exclusion & avoidance,
- integration: in the investment process the external investment manager assesses the ESG profile of a company. The external investment manager takes into account material risks in a given industry in combination with the company's respective risk exposure, practices and disclosure. Furthermore, the external investment manager looks into the company's exposure to past controversies and future ESG opportunities. A low score on ESG criteria can result in the demand for an additional premium on the company's bonds and/or initiation of an engagement with the issuer. If ESG risks are deemed too severe, an investment in the company will be avoided and/or existing holdings will be sold
- Engagement: As active long-term investors, the external investment manager performs comprehensive engagements with portfolio companies with the objective to unlock value and reduce risk. The external investment manager engagement process defines clear objectives of which the progress and result is tracked and well documented. If at any stage the company refuses to cooperate, divestment has to be considered.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

For information, the Sub-Fund will aim to lower the duration by an equivalent of the duration of its Reference Portfolio using listed derivatives.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>35%
Thermal Coal Extraction	>10%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Tobacco Producing Companies	>0%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

## ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Exclusion of the companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. The External Investment Manager considers for inclusion in the portfolio companies which score CCC or above and taking the external data provider MSCI ESG.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.

## ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

The External Investment Manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. The External Investment Manager utilises its UN Global Compact Exclusion process and resulting list. The Stewardship and Sustainability team and UN Global Compact Committee of the external investment manager (including representatives from all asset classes) are responsible for the ongoing monitoring and oversight of said exclusion list, and assess individual companies and cases via 7 key principles in order to determine status. These are: pattern of behaviour, legitimacy, assurance, engagement, duration and extent of behaviour. As inputs to the research process, the external investment manager uses third-party ESG data vendors alongside company disclosures and news.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

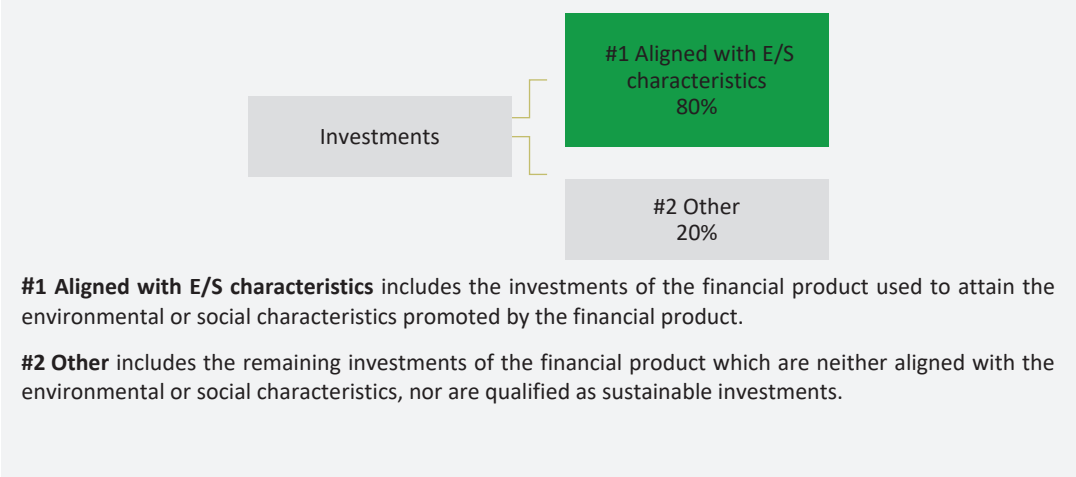
**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

## ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

Yes:
  In fossil gas
 In nuclear energy

No

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

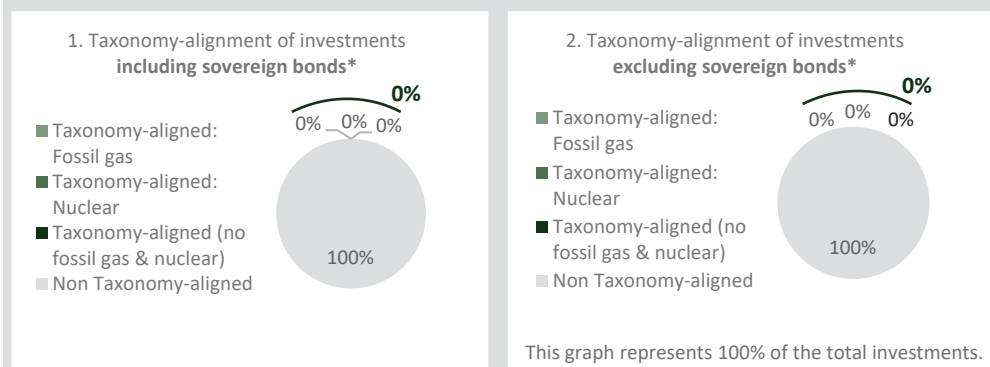
<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.



## ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

## ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?**

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.



**Where can I find more product specific information online?**

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html)  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- [Documents of the Sub-Fund:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html)  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

## ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

**Legal entity identifier:**

549300OKY4JTQC0B2J87

### Sustainable investment objective

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

**Does this financial product have a sustainable investment objective?**

<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Yes</b>	<input type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>No</b>
<p><input checked="" type="checkbox"/> It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: 25%</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> </ul> <p><input checked="" type="checkbox"/> It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: 25%</p>	<p><input type="checkbox"/> It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> <li><input type="checkbox"/> with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> <li><input type="checkbox"/> with a social objective</li> </ul> <p><input type="checkbox"/> It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments</p>



**What is the sustainable investment objective of this financial product?**

ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities (“the Sub-Fund) follows a multi-thematic sustainable investment strategy. The portfolio will be composed of issuers which are positively exposed to three long-term sustainable themes such as (i) better resource efficiency, (ii) improved health as well as (iii) greater safety and resilience.

The environmental sustainable investment objective of the Sub-Fund is to invest in businesses which support the goal of net zero greenhouse gas emissions by 2050, in line with the external investment manager’s Net-Zero Asset Managers Initiative (NZAM) commitment and the goals of the Paris Agreement. The practical working assumption is based on the Intergovernmental Panel on Climate Change (IPCC) analysis conclusion that to meet the Paris Agreement (to stay below 2 degrees centigrade ideally 1.5 degrees centigrade) of global warming we must reach net zero emissions by 2050. To achieve this

## ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

the fund will reduce absolute emissions by 50% between 2020 and 2030, and a further 50% between 2030 and 2040 and a further 50% by 2050. This includes front-loaded absolute emission reduction targets (25% reduction by 2025 versus 2019 and 50% by 2030), as well as discouraging use of offsets in the investment manager's engagement with companies. This is measured through several different metrics to capture the multi-faceted aim of investing in companies consistent with climate change goals. This includes exposure to companies reducing emissions (solution providers), the Sub-Fund's exposure to companies, carbon foot-printing that is consistent with the investment manager's NZAMI commitment. The approach is in line with the expectations of the Commission Delegated Regulation (EU) 2020/1818 relating to GHG scopes, calculation methodologies and exclusions. In addition, as part of its social sustainable investment objective, the Sub-Fund invests in companies contributing positively to social solutions.

To define the sustainable investment universe, a "pass-fail" approach is used using a set of criteria. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the sustainable objectives followed by the Sub-Fund.

### ● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The analysis of certain sustainability indicators is systematically integrated into the investment decision making process. The attainment of the sustainable investment objectives is assessed by investing in securities financing economic activities that substantially contribute to the environmental and/or social objectives mentioned above. To define the sustainable investment universe, a "pass-fail" approach using a set of criteria. No other criteria than the ones mentioned below are used to define the sustainable investment nature of an investment. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe.

To be eligible to the investment universe, we use the below criteria:

- Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed Science Based Target (SBT)", or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets.
- Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
- Having a net positive aggregated overall SDG by reference to the Sustainable Development Goals. This criterion, sourced from the external data provider ISS, assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer's product portfolio on the achievement of sustainability objectives. For corporate issuers the SDG Solutions Score considers only the most distinct objectives scores, i.e., the highest positive and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The

**Sustainability indicators** measure how the sustainable objectives of this financial product are attained.

## ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

SDG Solutions Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.

- Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of these criteria or (ii) a differentiated view of the company's impact assessment leveraging the External Investment Manager's proprietary methodology.

### ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

The "Do No Significant Harm" (DNSH) principle is complied by taking into account adverse impacts indicators listed in the Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022. The Sub-Fund takes into consideration (for some of them using proxies) all the mandatory adverse impact indicators listed in Table 1 of Annex 1 that are applicable to investee companies.

In addition, the Sub-Fund takes into consideration PAI No. 4 in Table 2 of Annex 2, applicable to investee companies, relating to investments in companies without carbon reduction initiatives. The Sub-Fund also takes into consideration PAI No. 15 of Table 3 of Annex 1, applicable to investee companies, relating to the lack of anti-corruption and anti-bribery policies.

### ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

The Sub-Fund considers adverse impacts of its investments on society and the environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusions of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 in portfolio management decisions and exclusions, using proxy indicators.

- the exposure to controversial weapons (i.e., PAI 14)

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator "investing in companies without carbon emission reduction initiatives" (i.e., PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the indicator "lack of anti-corruption and anti-bribery policies" (i.e. PAI 15) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

### ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

The Sub-Fund's sustainable investments are aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the United Nations Guiding Principles on

## ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Business and Human Rights, including the principles and rights set forth in the 8 “fundamental” conventions identified in the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work (covering subjects considered to be fundamental principles and rights at work, e.g., freedom of association and the right to collective bargaining, the elimination of all forms of forced or compulsory labour, the effective abolition of child labour, and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation) and the International Bill of Human Rights.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers adverse impacts of its investments on society and the environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusion of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 and 16 in portfolio management decisions exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator “investing in companies without carbon emission reduction initiatives” (i.e., PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the optional indicator “lack of anti-corruption and anti-bribery policies” (i.e. PAI 15) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund uses a combination of financial and non-financial indicators to identify securities. The sustainability criteria are designed to identify companies with strong environmental and social thematic exposures. The Sub-Fund follows a multi-thematic sustainable approach. The portfolio will be composed of issuers exposed to three long term mega trends, namely better resource efficiency, improved health as well as greater safety and resilience. The external investment manager ultimately seeks to invest in the economy of the future and has identified 21 sustainable themes that contribute in different ways to a cleaner, healthier and safer planet and which are connected to the three broader mega trends.

Better resource efficiency	Improved health	Greater safety and resilience
----------------------------	-----------------	-------------------------------

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

<ul style="list-style-type: none"> <li>• Improving the efficiency of energy use</li> <li>• Improving the management of water</li> <li>• Increasing electricity generation from renewable sources</li> <li>• Improving the resource efficiency of industrial and agricultural processes</li> <li>• Delivering a circular materials economy</li> <li>• Making transportation more efficient</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Providing affordable healthcare</li> <li>• Connecting people</li> <li>• Delivering healthier foods</li> <li>• Building better cities</li> <li>• Providing education</li> <li>• Enabling innovation in healthcare</li> <li>• Enabling healthier lifestyles</li> <li>• Encouraging sustainable leisure</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Increasing financial resilience</li> <li>• Saving for the future</li> <li>• Ensuring a sustainable economy</li> <li>• Leading ESG management</li> <li>• Improving transport safety</li> <li>• Enhancing digital security</li> <li>• Better monitoring of supply chains and quality control</li> </ul>
--	--	--

While a company must derive more than 25% of the value of its business directly from a theme, the external investment manager assesses how sustainable the rest of its activities are. For each business, the external investment manager determines the key ESG factors that are important indicators of future success and assess how well these are managed via the external investment manager proprietary tool named the Sustainability Matrix. Every company held in the portfolio is given a Matrix rating, which analyses the following two dimensional aspects:

- **Product sustainability (rated from A to E):** Assesses the extent to which a company's core business helps or harms society and/or the environment. An A rating indicates a company whose products or services contribute to sustainable development (via our investment themes); an E rating indicates a company whose core business is in a conflict with sustainable development (such as tobacco or very polluting activities such as coal fired electricity generation).
- **Management quality (rated from 1 to 5):** Assesses whether a company has appropriate structures, policies and practices in place for managing its ESG risks and impacts. Management quality in relation to the risks and opportunities represented by potentially material ESG issues are graded from 1 (excellent) to 5 (very poor).

In order to be investable, the company score must attain a minimum C3 rating. Engagement is also a key pillar of the external investment manager's approach. The external manager identifies three types of engagement: reactive, proactive and collaborative. Reactive engagement is initiated at the request of the external investment manager as a result of questions or concerns arising from the initial analysis of ESG issues, ongoing monitoring of holdings, emerging issues or controversies. Engagement also occurs at the request of a company (e.g., by providing feedback or advice on ESG initiatives). For proactive engagement, the external investment manager sets targets each year.

## ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies non-compliant with SFDR Sustainable Investments mandatory norms and conventions	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>5%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Exclusion of the companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. According to the proprietary sustainable matrix of the external investment manager, the sub-fund will not invest in companies with a proprietary Sustainability Matrix scoring below C3.
- Sustainable investment eligibility criteria (the below criteria may not be cumulative):
  - Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed



## ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Science Based Target (SBT)», or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets.

- o Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
- o Having a net positive aggregated Overall SDG Score by reference to the Sustainable Development Goals. The criterion is sourced from the external data provider ISS. This criterion assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer's product portfolio on the achievement of sustainability objectives. For corporate issuers the SDG Solutions Score considers only the most distinct objectives scores, i.e., the highest positive and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solutions Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.
- o Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of these criteria or (ii) a differentiated view of the company's impact assessment leveraging the External Investment Manager's proprietary methodology.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its "Good Governance Policy", the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS "exclusion policy" are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

## ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

The external investment manager assessment of good governance is systematically included in the research for each company as part of the decision on whether the business meets the requirements to be eligible for the Sub-Fund through the Sustainability matrix.

The assessment of the quality of management by the external investment manager includes the evaluation of the following elements: inter alia board structure, independence of board, key committees and auditors, stakeholder relationships including staff, customers and suppliers, pay alignment of board and staff with good business results. The external investment manager acknowledges different geographical contexts and what is good governance practice in the relevant region.



### What is the asset allocation and the minimum share of sustainable investments?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the sustainable investment process in place, hence in investments that are defined as sustainable (#1 Sustainable). The external investment manager’s proprietary sustainable analysis covers 100% of the “#1 Sustainable” investments.” #1 Sustainable” investments include a minimum of 25% assets with environmental objectives and 25% with social objectives. Investments with environmental objectives are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy.

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Not Sustainable). “#2 Not Sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging purpose as a technique of portfolio management efficiency. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine

**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

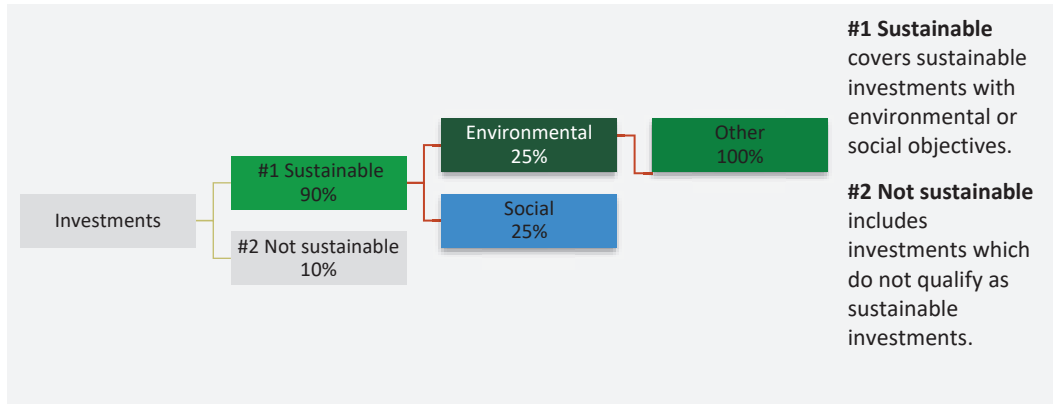
## ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee



**#1 Sustainable** covers sustainable investments with environmental or social objectives.

**#2 Not sustainable** includes investments which do not qualify as sustainable investments.

● **How does the use of derivatives attain the sustainable investment objective?**

Not Applicable



**To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

The Sub-Fund's sustainable investments with an environmental objective are not aligned with the EU taxonomy (i.e. 0%) as the investments with an environmental objective are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU taxonomy.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

- Yes:
  - In fossil gas
  - In nuclear energy
- No

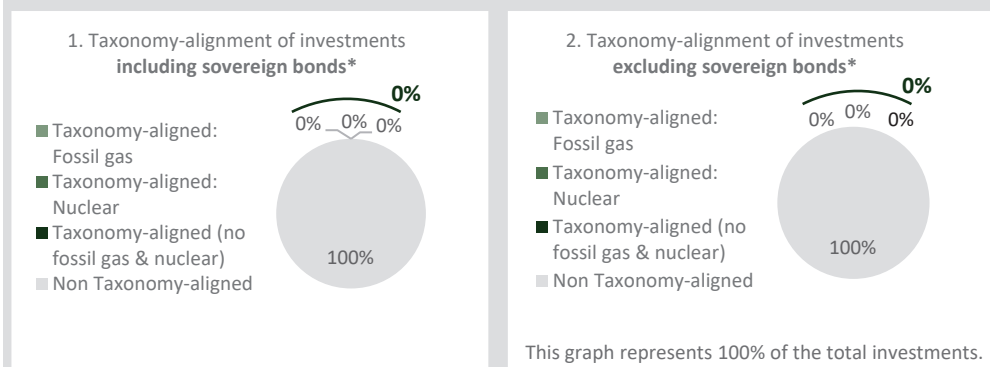
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy is 100%. The Sub-Fund commits to make a minimum of 25% sustainable investments with an environmental objective not aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund commits to make a 25% minimum share of sustainable investments with a social objective.



### What investments are included under “#2 Not sustainable”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Not Sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging purpose as a technique of portfolio management efficiency. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.

## ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Is a specific index designated as a reference benchmark to meet the sustainable investment objective?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How does the reference benchmark take into account sustainability factors in a way that is continuously aligned with the sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- **ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:**  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- **Documents of the Sub-Fund:**  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

**Legal entity identifier:**

549300LNEYGCDF2S5C79

### Sustainable investment objective

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

**Does this financial product have a sustainable investment objective?**

<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Yes	<input type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="checkbox"/> No
<p><input checked="" type="checkbox"/> It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: 35%</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> </ul> <p><input checked="" type="checkbox"/> It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: 35%</p>	<p><input type="checkbox"/> It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> <li><input type="checkbox"/> with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> <li><input type="checkbox"/> with a social objective</li> </ul> <p><input type="checkbox"/> It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments</p>



**What is the sustainable investment objective of this financial product?**

ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities (“the Sub-Fund) follows a multi-thematic sustainable investment strategy. The portfolio will be composed of issuers which are positively exposed to three long-term sustainable themes such as (i) better resource efficiency, (ii) improved health as well as (iii) greater safety and resilience.

The environmental sustainable investment objective of the Sub-Fund is to invest in businesses which support the goal of net zero greenhouse gas emissions by 2050, in line with the external investment manager’s Net-Zero Asset Managers Initiative (NZAM) commitment and the goals of the Paris Agreement. The practical working assumption is based on the Intergovernmental Panel on Climate Change (IPCC) analysis conclusion that to meet the Paris Agreement (to stay below 2 degrees centigrade ideally 1.5 degrees centigrade) of global warming we must reach net zero emissions by 2050. To achieve this

## ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

the fund will reduce absolute emissions by 50% between 2020 and 2030, and a further 50% between 2030 and 2040 and a further 50% by 2050. This includes front-loaded absolute emission reduction targets (25% reduction by 2025 versus 2019 and 50% by 2030), as well as discouraging use of offsets in the investment manager's engagement with companies. This is measured through a number of different metrics to capture the multi-faceted aim of investing in companies consistent with climate change goals. This includes: exposure to companies reducing emissions (solution providers), the Sub-Fund's exposure to companies, carbon foot-printing that is consistent with the investment manager's NZAMI commitment. The approach is in line with the expectations of the Commission Delegated Regulation (EU) 2020/1818 relating to GHG scopes, calculation methodologies and exclusions. In addition, as part of its social sustainable investment objective, the Sub-Fund invests in companies contributing positively to social solutions.

To define the sustainable investment universe, a "pass-fail" approach is used using a set of criteria. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the sustainable objectives followed by the Sub-Fund.

### ● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The analysis of certain sustainability indicators is systematically integrated into the investment decision making process. The attainment of the sustainable investment objectives is assessed by investing in securities financing economic activities that substantially contribute to the environmental and/or social objectives mentioned above. To define the sustainable investment universe, a "pass-fail" approach using a set of criteria. No other criteria than the ones mentioned below are used to define the sustainable investment nature of an investment. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe.

To be eligible to the investment universe, the Management Company uses the below criteria:

- Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed Science Based Target (SBT)", or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets.
- Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
- Having a net positive aggregated overall SDG Score (by reference to the Sustainable Development Goals). This criterion, sourced from the external data provider ISS, assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer's product portfolio on the achievement of sustainability objectives. For corporate issuers the SDG Solutions Score considers only the most distinct objectives scores, i.e., the highest positive and/or the

**Sustainability indicators** measure how the sustainable objectives of this financial product are attained.

## ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solutions Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.

- Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of these criteria or (ii) a differentiated view of the company's impact assessment leveraging the External Investment Manager's proprietary methodology.

### ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

The "Do No Significant Harm" (DNSH) principle is compiled by taking into account adverse impacts indicators listed in the Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022. The Sub-Fund takes into consideration (for some of them using proxies) all the mandatory adverse impact indicators listed in Table 1 of Annex 1 that are applicable to investee companies.

In addition, the Sub-Fund takes into consideration PAI No. 4 in Table 2 of Annex 2, applicable to investee companies, relating to investments in companies without carbon reduction initiatives. The Sub-Fund also takes into consideration PAI No. 15 of Table 3 of Annex 1, applicable to investee companies, relating to the lack of anti-corruption and anti-bribery policies.

### ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

The Sub-Fund considers adverse impacts of its investments on society and the environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusions of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator "investing in companies without carbon emission reduction initiatives" (i.e., PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the indicator "lack of anti-corruption and anti-bribery policies" (i.e. PAI 15 in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.).



## ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

### ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

The Sub-Fund's sustainable investments are aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights, including the principles and rights set forth in the 8 “fundamental” conventions identified in the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work (covering subjects considered to be fundamental principles and rights at work, e.g., freedom of association and the right to collective bargaining, the elimination of all forms of forced or compulsory labour, the effective abolition of child labour, and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation) and the International Bill of Human Rights.



### **Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?**

- Yes, the Sub-Fund considers adverse impacts of its investments on society and the environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusions of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator “investing in companies without carbon emission reduction initiatives” (i.e., PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the indicator “lack of anti-corruption and anti-bribery policies” (i.e. PAI 15) using proxy indicators.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### **What investment strategy does this financial product follow?**

The Sub-Fund uses a combination of financial and non-financial indicators to identify securities. The sustainability criteria are designed to identify companies with strong environmental and social thematic exposures. The Sub-Fund follows a multi-thematic sustainable approach. The portfolio will be composed of issuers exposed to three long term mega trends, namely better resource efficiency, improved health as well as greater safety and resilience. The external investment manager ultimately seeks to invest in the economy of the future and has identified 21 sustainable themes that contribute in different ways to a cleaner, healthier and safer planet and which are connected to the three broader mega trends.

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Better resource efficiency	Improved health	Greater safety and resilience
<ul style="list-style-type: none"> <li>• Improving the efficiency of energy use</li> <li>• Improving the management of water</li> <li>• Increasing electricity generation from renewable sources</li> <li>• Improving the resource efficiency of industrial and agricultural processes</li> <li>• Delivering a circular materials economy</li> <li>• Making transportation more efficient</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Providing affordable healthcare</li> <li>• Connecting people</li> <li>• Delivering healthier foods</li> <li>• Building better cities</li> <li>• Providing education</li> <li>• Enabling innovation in healthcare</li> <li>• Enabling healthier lifestyles</li> <li>• Encouraging sustainable leisure</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Increasing financial resilience</li> <li>• Saving for the future</li> <li>• Ensuring a sustainable economy</li> <li>• Leading ESG management</li> <li>• Improving transport safety</li> <li>• Enhancing digital security</li> <li>• Better monitoring of supply chains and quality control</li> </ul>

While a company must derive more than 50% of the value of its business directly from a theme, the external investment manager assesses how sustainable the rest of its activities are. For each business, the external investment manager determines the key ESG factors that are important indicators of future success and assess how well these are managed via the external investment manager proprietary tool named the Sustainability Matrix. Every company held in the portfolio is given a Matrix rating, which analyses the following two dimensional aspects:

- **Product sustainability (rated from A to E):** Assesses the extent to which a company's core business helps or harms society and/or the environment. An A rating indicates a company whose products or services contribute to sustainable development (via our investment themes); an E rating indicates a company whose core business is in a conflict with sustainable development (such as tobacco or very polluting activities such as coal fired electricity generation).
- **Management quality (rated from 1 to 5):** Assesses whether a company has appropriate structures, policies and practices in place for managing its ESG risks and impacts. Management quality in relation to the risks and opportunities represented by potentially material ESG issues are graded from 1 (excellent) to 5 (very poor).

Only companies which are rated A1-4, and B1-4 will be considered suitable for this Sub-Fund

Engagement is also a key pillar of the external investment manager's approach. The external manager identifies three types of engagement: reactive, proactive and collaborative. Reactive engagement is initiated at the request of the external investment manager as a result of questions or concerns arising from the initial analysis of ESG issues, ongoing monitoring of holdings, emerging issues or controversies. Engagement also occurs at the request of a company (e.g., by providing feedback or advice on ESG initiatives). For proactive engagement, the external investment manager sets targets each year.

## ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies non-compliant with SFDR Sustainable Investments mandatory norms and conventions	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Exclusion of the companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. According to the proprietary sustainable matrix of the external investment manager, only companies which are rated A1-4, and B1-4 will be considered suitable for this Sub-Fund.
- Sustainable investment eligibility criteria (the below criteria may not be cumulative):
  - Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed

## ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Science Based Target (SBT)», or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets.

- o Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
- o Having a net positive aggregated Overall SDG Score (by reference to the Sustainable Development Goals). The criterion is sourced from the external data provider ISS. This criterion assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer's product portfolio on the achievement of sustainability objectives. For corporate issuers the SDG Solutions Score considers only the most distinct objectives scores, i.e., the highest positive and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solutions Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.
- o Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of these criteria or (ii) a differentiated view of the company's impact assessment leveraging the External Investment Manager's proprietary methodology.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its "Good Governance Policy", the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS "exclusion policy" are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

## ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

The external investment manager assessment of good governance is systematically included in the research for each company as part of the decision on whether the business meets the requirements to be eligible for the Sub-Fund through the Sustainability matrix. The assessment of the quality of management by the external investment manager includes the evaluation of the following elements: inter alia board structure, independence of board, key committees and auditors, stakeholder relationships including staff, customers and suppliers, pay alignment of board and staff with good business results. The external investment manager acknowledges different geographical contexts and what is good governance practice in the relevant region.



### What is the asset allocation and the minimum share of sustainable investments?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the sustainable investment process in place, hence in investments that are defined as sustainable (#1 Sustainable). The external investment manager’s proprietary sustainable analysis covers 100% of the “#1 Sustainable” investments.” #1 Sustainable” investments include a minimum of 35% assets with environmental objectives and 35% with social objectives. Investments with environmental objectives are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy.

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Not Sustainable). “#2 Not Sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging purpose as a technique of portfolio management efficiency. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine

**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

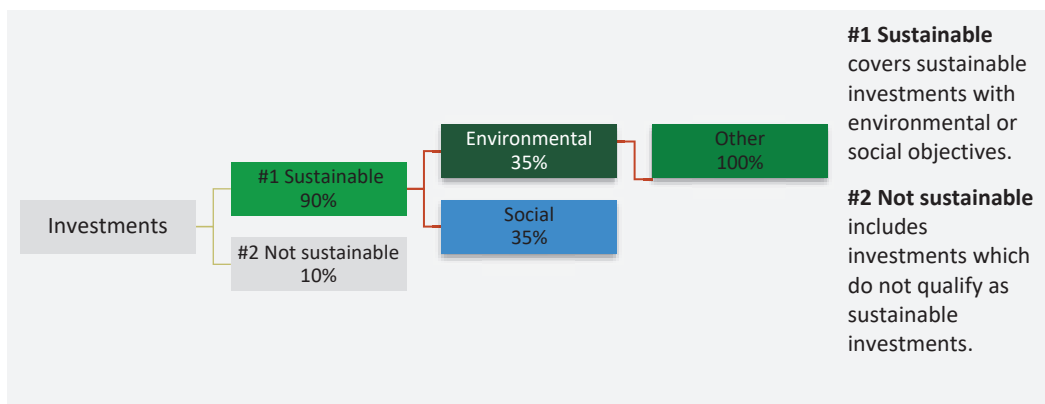
## ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee



**#1 Sustainable** covers sustainable investments with environmental or social objectives.

**#2 Not sustainable** includes investments which do not qualify as sustainable investments.

● **How does the use of derivatives attain the sustainable investment objective?**

Not Applicable



**To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

The Sub-Fund's sustainable investments with an environmental objective are not aligned with the EU taxonomy (i.e. 0%) as the investments with an environmental objective are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU taxonomy.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

- Yes:
- In fossil gas     In nuclear energy
- No

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules.

**Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

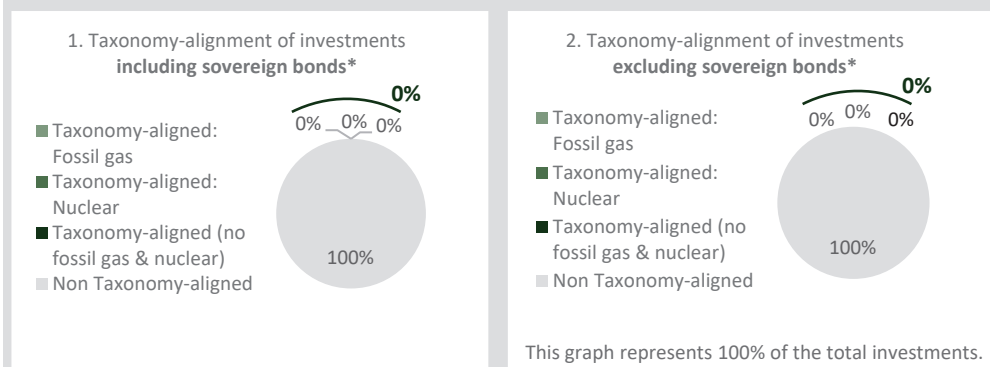
**Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy is 100%. The Sub-Fund commits to make a minimum of 35% sustainable investments with an environmental objective not aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund commits to make a 35% minimum share of sustainable investments with a social objective.



### What investments are included under “#2 Not sustainable”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Not Sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging purpose as a technique of portfolio management efficiency. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.

## ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Is a specific index designated as a reference benchmark to meet the sustainable investment objective?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How does the reference benchmark take into account sustainability factors in a way that is continuously aligned with the sustainable investment objective?***  
Not Applicable
- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***  
Not Applicable
- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***  
Not Applicable
- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***  
Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- **ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:**  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- **Documents of the Sub-Fund:**  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>



## ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities

**Legal entity identifier:**

5493003UERS4D705CR90

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

## ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading or improving on ESG practices.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

## ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

## ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund aims to invest in emerging market equities. Consideration of ESG Factors is fully integrated into fundamental analysis and investment decisions. The external investment manager's fundamental analysis includes an assessment of ESG Factors, alongside other financial and operational characteristics. Following the ESG-related quality assessment, the external investment manager quantifies ESG risks for these companies, to determine whether these have been accounted for, in company's valuation. The external investment manager favors issuers with better ESG characteristics where this is not detrimental to the pursuit of the investment objective.

Consideration of ESG Factors is fully integrated into analysis and investment decisions. In order to identify securities for purchase, the External Investment Manager reduces the potential investment universe (i) by screening out the exclusions (ii) by further analysing ESG factors to identify and take advantage of investment opportunities. This process results in a portfolio with better ESG characteristics. In constructing a portfolio positively tilted towards investments with better ESG characteristics, the External Investment Manager may nonetheless invest in investments across the full spectrum of ESG ratings.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
<b>Company Exclusions based on Revenue Thresholds</b>	
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>35%
Thermal Coal Extraction	>10%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Tobacco Producing Companies	>0%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis.

## ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy

- **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

## ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

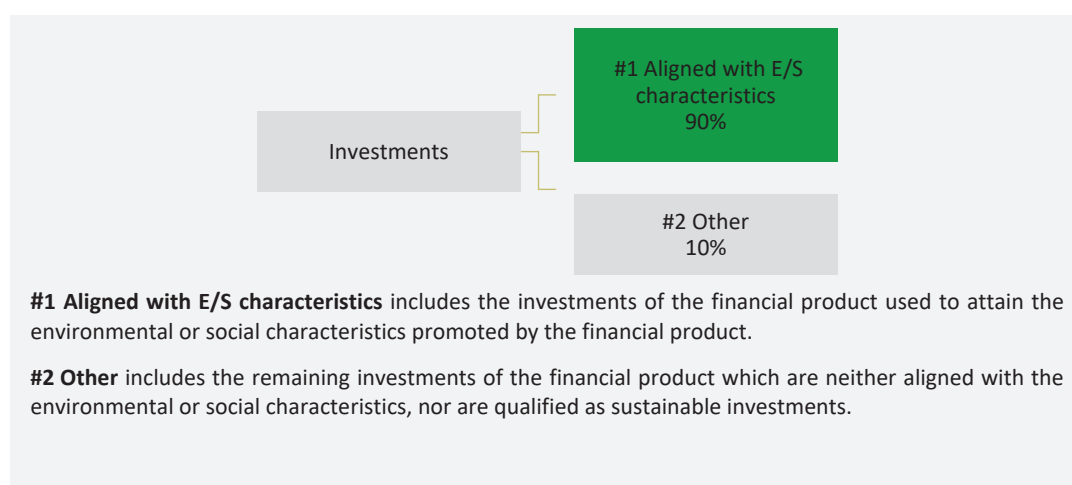
### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



#### ● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



#### **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

## ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities

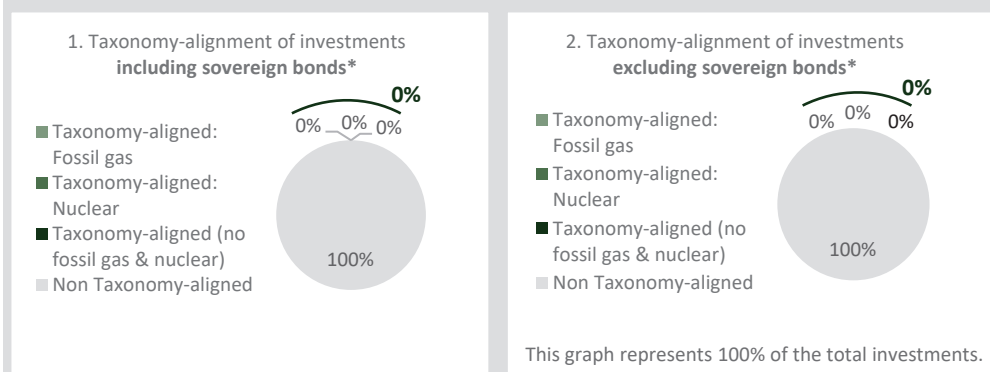
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

- Yes:
- In fossil gas     In nuclear energy
- No

*The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



**What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable



**What is the minimum share of socially sustainable investments?**

Not Applicable

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html):  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- [Documents of the Sub-Fund](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html):  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.



## ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

**Legal entity identifier:**

549300DWB404Y7TZVH53

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of 30% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities (the “Sub-Fund”). The External Investment Manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall sustainability strengths going from the

## ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

## ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

The portfolio will be partially composed of companies exposed to the UN Sustainable Development Goals (SDGs). The Sub-Fund invests in companies contributing positively to environmental and social solutions. The Sub-Fund seeks to achieve positive environmental impact by investing primarily in companies that are leading the way to a zero-carbon economy and have approved Science-Based Targets. To define the sustainable investment universe, a “pass-fail” approach is used using a set of criteria. The DNSH principle is applied on all Sustainable Investments.

The analysis of certain sustainability indicators is systematically integrated into the investment decision making process of sustainable investments defined as securities financing economic activities that contribute to the environmental and/or social objectives mentioned above. To be eligible to the sustainable investment universe, the Management Company uses the below criteria:

- Having a net positive aggregated overall SDG score. This criterion, sourced from external data provider ISS, assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer’s product portfolio on the achievement of sustainability objectives. For corporate issuers, the SDG Solutions Score considers only the most distinct objective scores, i.e., the highest positive and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solution Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.
- Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed Science Based Target (SBT)", or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets.
- Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
- Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of these criteria or (ii) a differentiated view of the company's impact assessment leveraging the External Investment Manager's proprietary methodology.

## ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

### ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

The "Do No Significant Harm" (DNSH) principle is complied by taking into account adverse impacts indicators listed in the Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022. The Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make take into consideration (for some of them using proxies) all the mandatory adverse impact indicators listed in Table 1 of Annex 1 that are applicable to investee companies.

In addition, the Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make take into consideration PAI No. 4 in Table 2 of Annex 2, applicable to investee companies, relating to investments in companies without carbon reduction initiatives. The Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make also take into consideration PAI No. 15 of Table 3 of Annex 1, applicable to investee companies, relating to the lack of anti-corruption and anti-bribery policies.

### ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

The Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make consider adverse impacts of its investments on society and the environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusions of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make take into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make consider the optional indicator "investing in companies without carbon emission reduction initiatives" (i.e., PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators. With respect to Table 3, the Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make consider the optional indicator "lack of anti-corruption and anti-bribery policies" (i.e. PAI 15) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

### ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

The Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make are aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights, including the principles and rights set forth in the 8 "fundamental" conventions identified in the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles

## ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

and Rights at Work (covering subjects considered to be fundamental principles and rights at work, e.g., freedom of association and the right to collective bargaining, the elimination of all forms of forced or compulsory labour, the effective abolition of child labour, and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation) and the International Bill of Human Rights.

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

Any other sustainable investments must also not significantly harm any environmental or social objectives.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Moreover, the Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make consider adverse impacts of its investments on society and the environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusions of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make take into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make consider the optional indicator “investing in companies without carbon emission reduction initiatives” (i.e., PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators. With respect to Table 3, the Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make consider the optional indicator “lack of anti-corruption and anti-bribery policies” (i.e. PAI 15) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

■ No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

## ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

The External Investment Manager has set up a process that integrates fundamental and ESG (Environment, Social and Governance) research to assess the business quality and valuation of potential companies. The ESG assessments include both exclusionary screens and a bottom up ESG evaluation. The investment strategy relies on a three-step process:

- In order to determine ESG performance, the External Investment Manager reviews first scoring from third-party ESG ratings providers (MSCI, ISS and Sustainalytics), evaluates how business controversies may materially impact companies, eliminates companies with exposure to controversial business lines, and performs a qualitative assessment on a broad range of ESG factors. The first task of the External Investment Manager is then to evaluate potential investments to ensure that they are compliant with the firm's exclusionary screens (Gambling, Alcohol, Tobacco, Weapons, Fossil Fuels).
- In a second step, the External Investment Manager performs an extensive analysis of retained companies in order to evaluate their ESG profile including ESG relevant issues (material risks and opportunities) within the context of the underlying sector and industry. The External Investment Manager analyses each investment candidate's environmental, social and governance record, including their environmental impact; how they treat their employees; the quality of their relationships with local communities, customers and the supply chain; and their corporate governance policies and practices. This analysis emphasizes those issues that are most relevant and risks that are most material to the company and compares the company under review with their peers. The External Investment Manager assign a proprietary rating to each company depending on their assessment of how well the company is managing material and reputational risks. These scores help determine whether the company meets the ESG threshold to be considered for investment.
- A one-page ESG risk report is compiled for each potential holding. The report distills available ESG information, summarizes key positives and risks, documents the numeric reputational and material risk scores described above, and identifies opportunities for engagement.
  - o Each security is issued a materiality risk and reputational risk rating. Materiality risk refers to the likelihood of a company being financially impacted by its management of ESG topics. Reputational risk refers to the likelihood of a company's reputation being impacted by its management of ESG topics. The ratings use a 1 – 4 scale with 1 being a low-risk and 4 being a severe risk. Positive (+) and negative (-) modifiers are used to determine trajectory of the ratings. Securities that are scored a 4 in either their Materiality or Reputational risk rating indicates a "Fail Recommendation".
  - o Companies rated in the bottom quartile of the investment universe, as assessed by the ESG process, will not be considered for investment.

This report is a tool for the Chief Investment Officer of the External Investment Manager to use in making a final decision about whether the company is eligible for inclusion in the portfolio.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

## ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the External Investment Manager ESG suitability analysis in terms of Exclusion and ESG inclusion. As part of the ESG inclusion selection process of the External investment Manager, are eligible for investment companies that score within the three first quartiles of the universe as defined by the External investment Manager ESG scoring methodology.
- A part of the exclusion policy of the External Investment Manager, are excluded from investment:
  - o companies that generate more than 10% of revenues from (or are the market leaders in) (i) Manufacture of Alcohol (ii) Fossil Fuels (iii) Extraction, exploration, production and/or refining of fossil fuels

## ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- o companies operating in some controversial business activities such as deforestation, for-profit education or private prisons
- The Sub-Fund commits to return a lower Carbon emission exposure (scope 1 and 2) aggregated score than the benchmark.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below.

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.



## ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

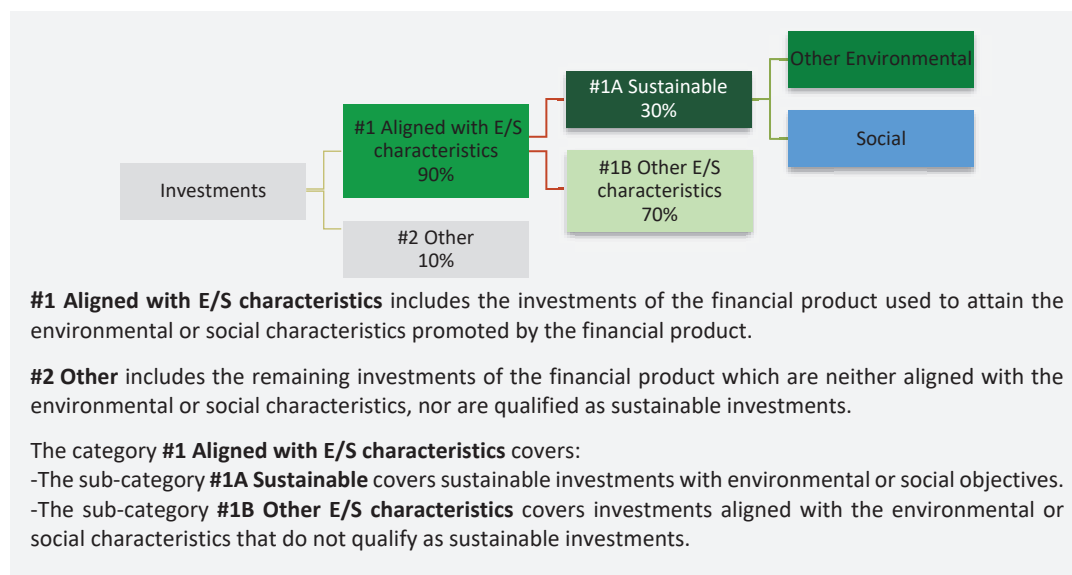
The External Investment Manager will evaluate the governance structure of any company under consideration for investment. As part of that process, the External Investment Manager considers shareholder-friendly policies and transparent reporting, leadership’s attention to ESG initiatives, management turnover, board accountability and expertise, executive compensation policies, women on board, as well as ownership and governance structures.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds), bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable

**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

## ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



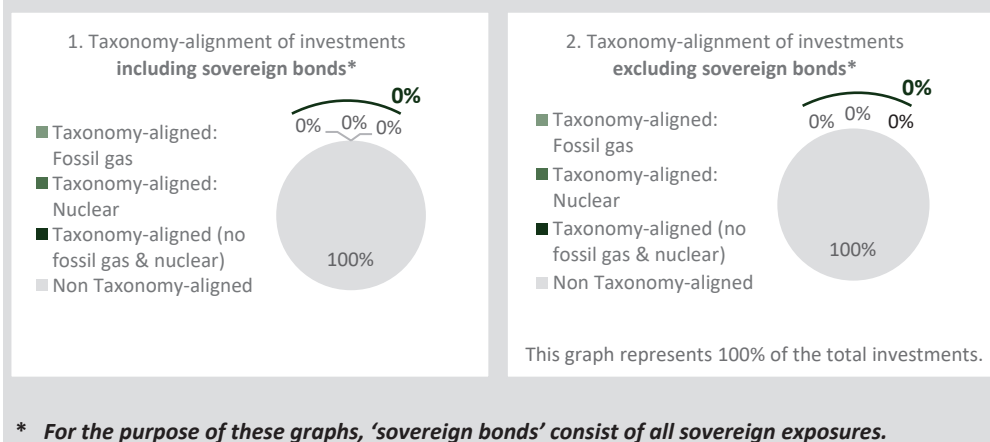
### To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund's sustainable investments with an environmental objective are not aligned with the EU taxonomy (i.e. 0%) as the investments with an environmental objective are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU taxonomy.

#### ● Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?

- Yes:
- In fossil gas     In nuclear energy
- No

*The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



#### ● What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

## ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund invests at least 30% of assets in Sustainable Investments. Out of the aforementioned 30%, the Sub-Fund commits to invest a minimum of 5% into sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund invests at least 30% of assets in Sustainable Investments. Out of the aforementioned 30%, the Sub-Fund commits to invest a minimum of 5% into socially sustainable investments.



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- **How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable

- **How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?**

Not Applicable

- **How does the designated index differ from a relevant broad market index?**

Not Applicable

- **Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?**

Not Applicable

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

**Legal entity identifier:**

549300GBNQDBDYPB9S98

### Sustainable investment objective

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

**Does this financial product have a sustainable investment objective?**

<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Yes	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="checkbox"/> No
<p><input checked="" type="checkbox"/> It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: 40%</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> </ul> <p><input checked="" type="checkbox"/> It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: 10%</p>	<p><input type="checkbox"/> It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> <li><input type="checkbox"/> with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy</li> <li><input type="checkbox"/> with a social objective</li> </ul> <p><input type="checkbox"/> It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments</p>



**What is the sustainable investment objective of this financial product?**

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds (“the Sub-Fund”) follows a multi-thematic sustainable investment strategy. The portfolio will be composed of entities exposed to the UN Sustainable Developments Goals (SDGs) and either considering the SDG Solutions Assessment (SDGA) methodology of the external data provider ISS (at entity level), or using an internal methodology to analyse the use of proceeds of the debt instrument (when considering green or social bonds). As part of its sustainable investment objective, the Sub-Fund invests in entities contributing positively to environmental and social solutions. To define the sustainable investment universe, a “pass-fail” approach is used using a set of criteria. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe.

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the sustainable objectives followed by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the sustainable objectives of this financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The analysis of certain sustainability indicators is systematically integrated into the investment decision making process. The attainment of the sustainable investment objectives is assessed by investing in securities financing economic activities that substantially contribute to the environmental and/or social objectives mentioned above. To define the sustainable investment universe, a “pass-fail” approach is used using a set of criteria. No other criteria than the one mentioned below are used to define the sustainable investment nature of an investment. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe.

To be eligible to the investment universe, the Management Company uses the below criteria:

- Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed Science Based Target (SBT)", or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets
- Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS
- Having a net positive aggregated overall SDG score (by reference to the Sustainable Development Goals). This criterion, sourced from the external data provider ISS, assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer's product portfolio on the achievement of sustainability objectives. For corporate issuers the SDG Solutions Score considers only the most distinct objective scores, i.e., the highest positive and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solution Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.
- Exposure to Green, Social, Sustainability or SDG bonds and related debts instruments. The Management Company will assess the use of proceeds eligibility.
- Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of these criteria or (ii) a differentiated view of the company's impact assessment made by the investment manager and based on other sources.

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

### ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

The "Do No Significant Harm" (DNSH) principle is complied by taking into account adverse impacts indicators listed in the Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022. The Sub-Fund takes into consideration (for some of them using proxies) all the mandatory adverse impact indicators listed in Table 1 of Annex 1 that are applicable to investee companies, sovereigns and supranationals.

In addition, the Sub-Fund takes into consideration PAI No. 4 in Table 2 of Annex 2, applicable to investee companies, relating to investments in companies without carbon reduction initiatives. The Sub-Fund also takes into consideration PAI No. 15 of Table 3 of Annex 1, applicable to investee companies, relating to the lack of anti-corruption and anti-bribery policies. The Sub-Fund takes into account PAI No.17 in Table 2, applicable to sovereigns and supranationals, relating to "Share of bonds not issued under Union legislation on environmentally sustainable bonds". The Sub-Fund also takes into consideration PAI No. 20 of Table 3, applicable to sovereigns and supranationals, relating to investments "Average human rights performance".

### ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

The Sub-Fund considers and mitigates adverse impacts of its investments on society and environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusions of issuers associated with controversial conduct or activities.

On the corporate side:

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator "investing in companies without carbon emission reduction initiatives" (i.e. PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the optional indicator "lack of anti-corruption and anti-bribery policies" (i.e. PAI 15) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

On the sovereign and supranational side:

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into consideration mandatory principal adverse impacts in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator "Share of bonds not issued under Union legislation on environmentally sustainable bonds" (i.e. PAI 17) in portfolio management decisions.

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the optional indicator “Average human rights performance” (i.e. PAI 20) in portfolio management decisions using proxy indicators.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

### — — — **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

The Sub-Fund's sustainable investments are aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights, including the principles and rights set forth in the 8 “fundamental” conventions identified in the International Labor Organization's Declaration on Fundamental Principles (covering subjects that were considered to be fundamental principles and rights at work, e.g. freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining, the elimination of all forms of forced or compulsory labour, the effective abolition of child labour, and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation) and Rights at Work and the International Bill of Human Rights. Alignment is ensured through exclusions.



### **Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?**

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers and mitigates adverse impacts of its investments on society and environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusion of issuers associated with controversial conduct or activities.

On the corporate side:

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator “investing in companies without carbon emission reduction initiatives” (i.e. PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the optional indicator “lack of anti-corruption and anti-bribery policies” (i.e. PAI 15) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

On the sovereign and supranational side:

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund considers the mandatory principal adverse impacts in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator “Share of bonds not issued under Union legislation on environmentally sustainable bonds” (i.e. PAI 17) in portfolio management decisions..

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the optional indicator “Average human rights performance” (i.e PAI 20) in portfolio management decisions using proxy indicators.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

No



### What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund will invest in Euro Investment Grade denominated (Sub)Sovereign, and Supranationals bonds incorporating as well, corporate bonds to the portfolio. The selection process targeting impact solutions would give the preference to green/ social/ sustainability/SDG bonds. Nonetheless, the Sub-Fund aims to invest at least 50% of its securities in Green, social, sustainability or SDG Bonds that have been qualified as such by an external party. The 50% target is subject to the flow of upcoming emissions which pass the sustainability filters.

The Sub-Fund uses a combination of financial and non-financial indicators to identify securities. It aims to foster the growth of a sustainable global economy without compromising returns. The sustainability criteria are designed to identify companies with strong environmental and social thematic exposures and more globally, debts instruments financing projects that are in line with the sustainability indicators. The Sub-Fund is actively managed combining both quantitative and qualitative financial modelling and impact research. Investments will be made into companies and/or projects with growth driven by long term sustainable impact themes and with the intent to contribute to measurable positive social, economic and environmental impact alongside financial returns. The Sub-Fund can invest in Companies, in Sovereign and in Supranational bonds.

Regarding corporate Investment: those are only aimed at companies that generate a net positive impact. These are companies with products or services that bring positive impact to the environment, climate and society. The process of selecting companies starts with applying quantitative screens on the global universe by using external ESG data providers. These screens consist of activity-based and norm-based exclusions, best-in-class ESG score (companies that are not scoring within the 50th percentile of each sector are not suitable for investing) and SDG’ solutions impact score.

Regarding countries and public organisations investments: The analysis is carried out at the country level. The process of selecting countries starts with applying quantitative screens on the global universe of countries by using external ESG data providers. These screens consist of activity-based and norm-based exclusions, and ESG risk score threshold (High and severe ESG risk scores are not eligible).

Regarding Supranational investments: the Sub-Fund does not follow a best-in-class approach for Supranational entities as their existence is tied almost directly to impact objective of adding to the United Nations Sustainable Development goals. Nonetheless the Sub-Fund will verify that the entity objectives are in line with its sustainable objectives.

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

When investing in green, social, sustainability or SDG bonds, the Sub-Fund may not apply the above screening; Nonetheless, the Sub-Fund will make sure that the bond's use of proceeds is verified by a third-party and that the objective of the bond is in line with the objectives of the Sub-Fund.

After this initial quantitative screening, the last step consists of the qualitative assessment performed by the investment manager of the Sub-Fund. The portfolio manager will ascertain the positive impact the selected investment bring.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies non-compliant with SFDR Sustainable Investments mandatory norms and conventions	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%
Government Exclusions based on Norms and Policies	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Sustainable investment eligibility criteria as below:
  - o Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed Science Based Target (SBT)", or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets
  - o Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
  - o Having a net positive aggregated overall SDG score (by reference to the Sustainable Development Goals). This criterion assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer's product portfolio on the achievement of sustainability objectives. For corporate issuers the SDG Solutions Score considers only the most distinct objective scores, i.e., the highest positive and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solutions Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.
  - o Exposure to Green, Social, Sustainability or SDG bonds and related debts instruments; The above criteria may not apply to the issuer of the debt instrument as the Sub-Fund will assess the use of proceed eligibility
  - o Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of these criteria or (ii) a differentiated view of the company's impact assessment leveraging the External Investment Manager's proprietary impact methodology..

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its "Good Governance Policy", the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS "exclusion policy" are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Note that the good governance requirements outlined in the SFDR regulation are only applicable to investments in corporates.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.



### What is the asset allocation and the minimum share of sustainable investments?

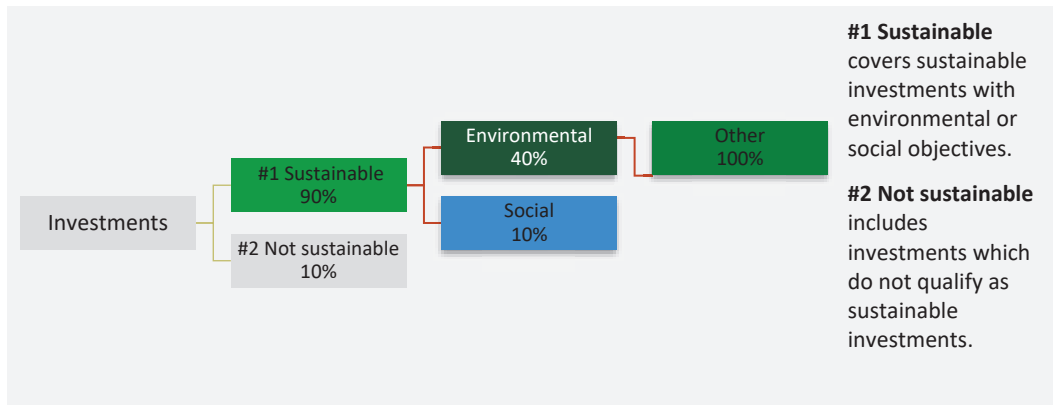
The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the sustainable investment process in place, hence in investments that are defined as sustainable (#1 Sustainable). The proprietary sustainable analysis covers 100% of the “#1 Sustainable” investments.” #1 Sustainable” investments include a minimum of 40% assets with environmental objectives and 10% with social objectives. Investments with environmental objectives are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy.

**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Not Sustainable). “#2 Not Sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for hedging purposes. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.



**#1 Sustainable** covers sustainable investments with environmental or social objectives.

**#2 Not sustainable** includes investments which do not qualify as sustainable investments.

- **How does the use of derivatives attain the sustainable investment objective?**  
Not Applicable



### To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund's sustainable investments with an environmental objective are not aligned with the EU taxonomy (i.e. 0%) as the investments with an environmental objective are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU taxonomy.

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

Yes:

In fossil gas     In nuclear energy

No

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules.

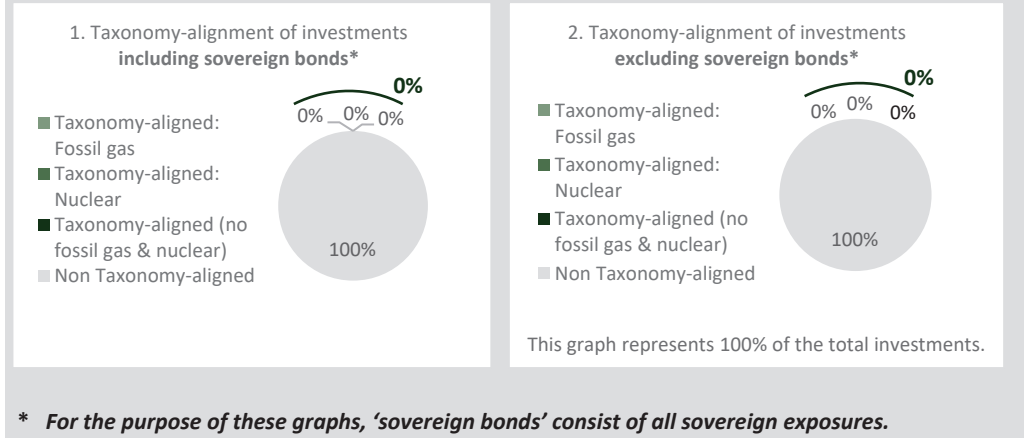
**Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

**Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

*The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy is 100%. The Sub-Fund commits to make a minimum of 40% sustainable investments with an environmental objective not aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund commits to make a 10% minimum share of sustainable investments with a social objective.



### What investments are included under “#2 Not sustainable”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Not sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for hedging and efficient management portfolio purposes. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to meet the sustainable investment objective?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How does the reference benchmark take into account sustainability factors in a way that is continuously aligned with the sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html)  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- [Documents of the Sub-Fund:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html)  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

#### Reference

**benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

**Legal entity identifier:**

549300WAD3VMVWTT3Z05

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds (the “Sub-Fund”). ESG integration is defined as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria.



## ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the financial product.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The analysis of ESG factors is integrated into the investment decision making process. The attainment of the promoted environmental and social characteristics is assessed via the application of a proprietary ESG assessment methodology.

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions - Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour).
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.

## ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Government emissions.

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

**How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

**How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement. On the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

## ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

No



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

To select eligible securities, the Management Company performs both a financial and non-financial analysis, using ESG criteria in combination with exclusions filters. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics. The Sub-Fund invest mainly in companies and in Sovereigns via debts instruments ("the securities") and may also invest in units or share of of undertakings for collective investments including exchange traded funds - ETF ("the investment funds").

The process of selecting the eligible securities starts with applying quantitative screens on a global universe by using the external ESG data provider Sustainalytics. These screens consist of activity-based and norm-based exclusions (negative filters) and ESG risk scores classification (positive filters). The purpose of the negative filters is to eliminate from investment, companies that violate international standards, activities that might have a negative effect on society and on environment (as tobacco and thermal coal). The Management Company will then rank the securities according to their ESG risk score as evaluated by Sustainalytics. The purpose of the ranking is to better allocate the ESG risk score in the portfolio. The Management company will only retain securities with an ESG risk score that is either negligible, low, medium or high. Investing in severe ESG risk score (>40) is not allowed. Moreover, as part of the controversy assessment and using Sustainalytics as the data source provider, the Management company will exclude companies with the highest controversy score (i.e level 5-severe out of 6 levels from 0 to 5).

The Management Company may invest in external or internal funds to expose the Sub-Fund on specific market (as emerging markets, for example). Those investment funds promote environmental and social characteristics and qualifies as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector ("SFDR Article 8") or contributes to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector ("SFDR art.9"). External investment funds are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes to the capabilities in place and the portfolio construction. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company (i.e., applicable only to direct investments).

The management team will select the securities within the eligible universe as filtered above and will construct the portfolio based on financial criteria (top-down and bottom up) to attain the financial objectives of the fund.

## ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
<b>Company Exclusions based on Revenue Thresholds</b>	
Thermal Coal Extraction	>10%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Tobacco Producing Companies	>0%
<b>Government Exclusions based on Norms and Policies</b>	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes
Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund ESG suitability criteria for investments as defined below:
  - o Direct investments: securities with an ESG risk score below 40 are eligible and a controversy level of 5 (or "severe") based on Sustainalytics data.
  - o Indirect investments: investment funds that promote environmental and social characteristics and qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or that contribute to environmental and social objectives and qualify as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services.
- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

## ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

### ● *What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?*

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

The good governance requirements outlined in the SFDR regulation are only applicable to investments in companies. Nonetheless, the external investment manager has in place a good governance methodology when it comes to consider emerging markets state-owned companies, sovereign agencies and sovereigns.

## ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

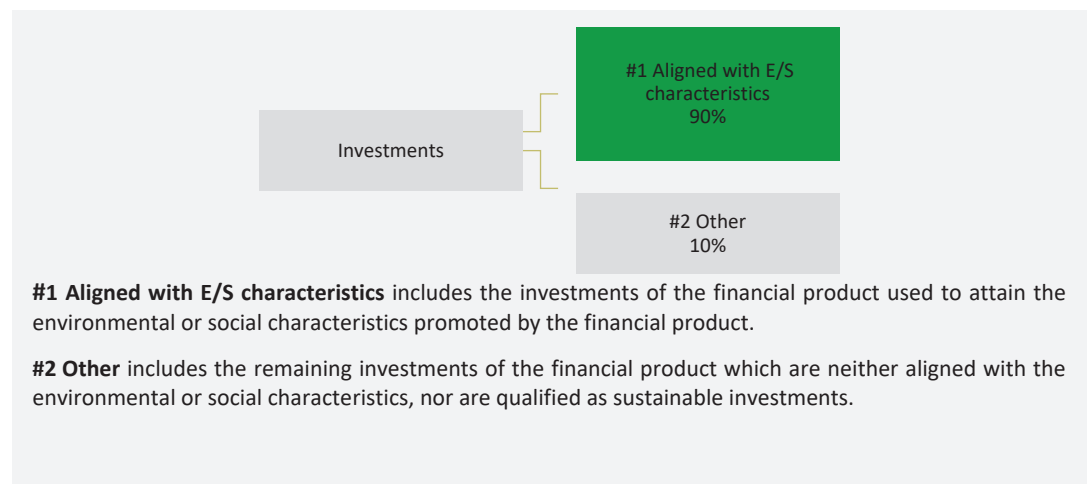
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Consequently, up to 10% of the investments may not be aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes investment funds (inc. ETF) that are not classified as “SFDR article 8” or “SFDR article 9”, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.



#### ● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



#### **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

## ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

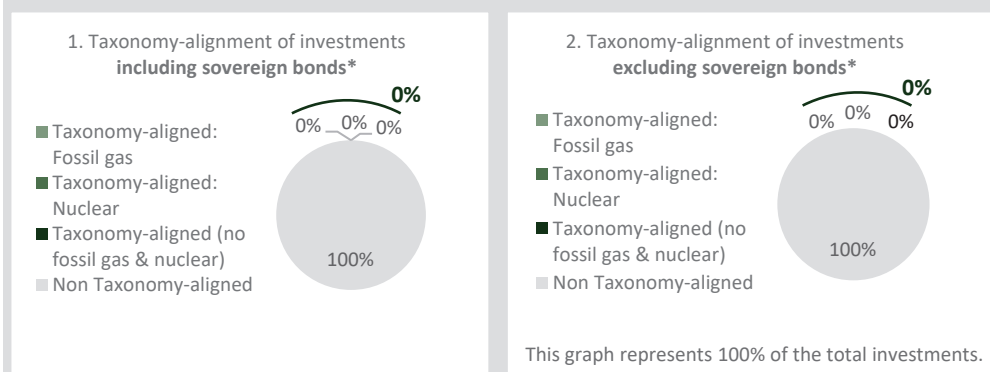
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

- Yes:
- In fossil gas     In nuclear energy
- No

*The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



**What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable



**What is the minimum share of socially sustainable investments?**

Not Applicable

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes investment funds (inc.ETF) that are not classified as “SDFR Article 8” or “SFDR article 9”, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html)  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>

- [Documents of the Sub-Fund:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html)  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.



## ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

**Legal entity identifier:**

549300R2N855J64YLN17

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities (the “Sub-Fund”). ESG integration is defined as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria.

## ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights and labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The analysis of ESG factors is integrated into the investment decision making process. The attainment of the promoted environmental and social characteristics is assessed via the application of a proprietary ESG assessment methodology.

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

## ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

**How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

**How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



**Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?**

Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, it strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

No

**What investment strategy does this financial product follow?**

To select eligible securities, the Management Company performs both a financial and non-financial analysis, using ESG criteria in combination with exclusions filters. The Sub-Fund’s assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics. The Sub-Fund will mainly invest in companies (equities) and may also invest in units or share of undertakings for collective investments (including exchange traded funds).

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The process of selecting companies starts with applying quantitative screens on a global universe by using the external ESG data provider Sustainalytics. These screens consist of activity-based and norm-based exclusions (negative filters) and ESG risk scores classification (positive filters). The purpose of the negative filters is to eliminate from investment, companies that violate international standards, activities that might have a negative effect on society and on environment (as tobacco and thermal coal). The Management Company will then rank the securities according to their ESG risk score as evaluated by Sustainalytics. The purpose of the ranking is to better allocate the ESG risk score in the portfolio. The Management company will only retain securities with an ESG risk score that is either negligible, low, medium or high. Investing in severe ESG risk score (>40) is not allowed. Moreover, as part of the controversy assessment and using Sustainalytics as the data source provider, the Management company will exclude companies with the highest controversy score (i.e level 5-severe out of 6 levels from 0 to 5).

The management team may invest in external or internal funds to expose the Sub-Fund on specific market (as emerging markets, for example). Those investment funds promote environmental and social characteristics and qualifies as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector (“SFDR Article 8”) or contributes to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector (“SFDR article 9). External investment funds are selected in accordance with the Management Company’s standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes to the capabilities in place and the portfolio construction. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the “Sustainability Investment Policy” of the Management Company (i.e., applicable only to direct investments).

The management team will select the securities within the eligible universe as filtered above and will construct the portfolio based on financial criteria (top-down and bottom up) to attain the financial objectives of the fund.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company’s exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact’s Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No

## ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Thermal Coal Extraction	>10%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Tobacco Producing Companies	>0%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-fund ESG suitability analysis for investments as defined below:
  - o Direct investments: securities with an ESG risk score below 40 are eligible and a controversy level of 5 (or “severe”) based on Sustainalytics data.
  - o Indirect investments: investment funds that promote environmental and social characteristics and qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or that contribute to environmental and social objectives and qualify as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

## ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund plans to invest at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics)).

Consequently, up to 10% of the investments may not be aligned with these characteristics (#2 Other). ““#2 Other” includes investment funds (and ETF) that are not classified as “SFDR Article 8” or “SFDR article 9”, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.

**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

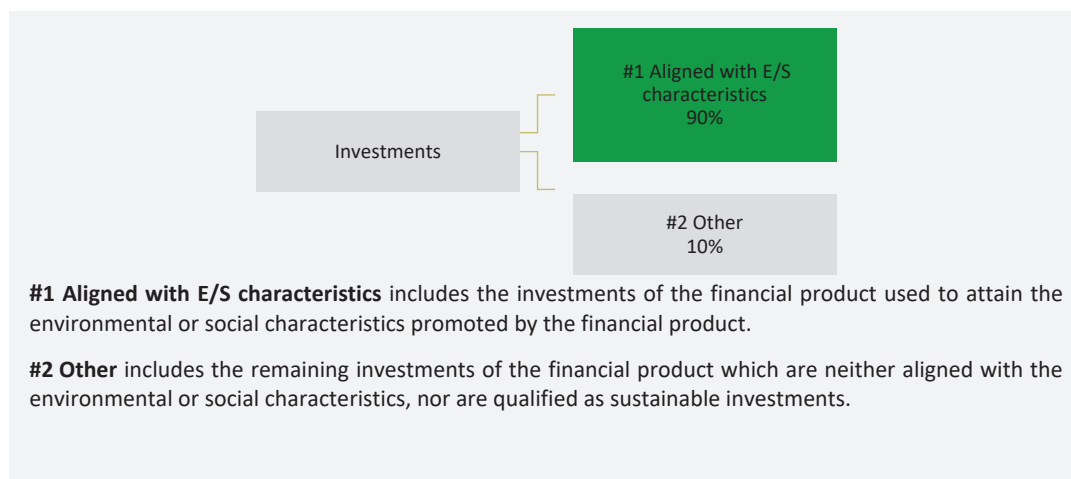
## ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.



**#1 Aligned with E/S characteristics** includes the investments of the financial product used to attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product.

**#2 Other** includes the remaining investments of the financial product which are neither aligned with the environmental or social characteristics, nor are qualified as sustainable investments.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

Yes:

In fossil gas

In nuclear energy

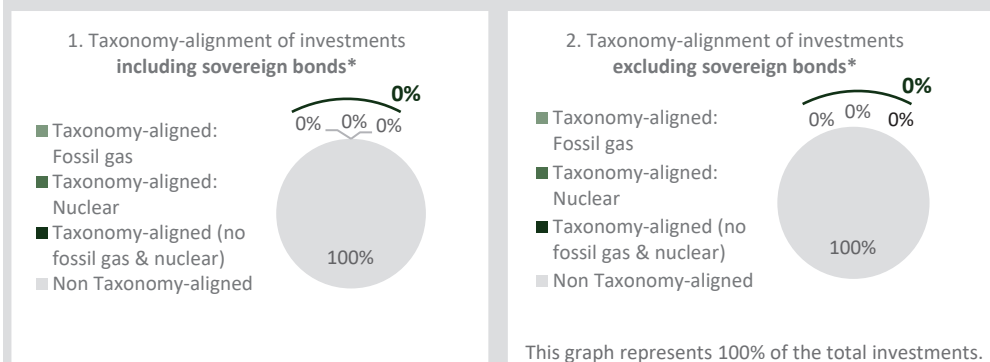
No

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

*The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



**What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable



**What is the minimum share of socially sustainable investments?**

Not Applicable



**What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?**

“#2 Other” includes investment funds (and ETF) that are not classified as “SFDR Article 8” or “SFDR article 9”, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



## ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?**

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***  
Not Applicable
- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***  
Not Applicable
- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***  
Not Applicable
- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***  
Not Applicable



**Where can I find more product specific information online?**

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html)  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- [Documents of the Sub-Fund:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html)  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

## ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

**Legal entity identifier:**

549300KADHEV1F9AHS35

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?



Yes



No



It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%



in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%



It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments



with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



with a social objective



It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria.

The External Investment Manager must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate

## ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

social responsibility policy as well as its overall sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights and labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

## ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, it strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

## ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

The strategy is actively managed through a proprietary ESG fundamental research driven approach and is complemented by an engagement approach. The ESG fundamental research driven approach is guided by the External Investment Manager 's internally developed materiality map and thematic maps inspired and guided by the Sustainability Accounting Standards Board (SASB), now part of the International Sustainability Standards Board (ISSB).

The materiality map helps to utilize context specific analysis for individual companies and identifies key criteria for each potential sustainability leadership within their industry. Markers of sustainability leadership include:

- Material: Are the areas of sustainability leadership relevant to long-term business success?
- Proactive: Does the activity go above and beyond compliance or sufficiency?
- Progressive: Is reporting transparent and analysable?
- Effective: Can we identify meaningful positive impact both for the company and beyond (customers, suppliers, and systems)?

As an illustration of the materiality map,

- Key criteria to measure sustainability leadership in Utilities with regards to:
  - Governance: board structure and composition, management incentives, ownership, systemic risk management and leadership and corporate purpose, culture and mission alignment
  - Social: diversity, equity and inclusion, employee well-being and development.
  - Environment: climate change risk, climate change mitigation and adaptation, GHG Emissions, energy intensity and renewable energy use, biodiversity and ecosystems impact
- Key criteria to measure sustainability leadership in healthcare with regards to:
  - Governance: board structure and composition, management incentives, ownership, systemic risk management and leadership and corporate purpose, culture and mission alignment
  - Social: diversity, equity and inclusion, employee well-being and development, supplier, distribution and marketing management, product impact and customer well-being, pricing philosophy and access and Privacy, data security and data use.

The thematic map complements the External investment Manager's materiality map by asking forward-looking questions (e.g., What is needed to improve the health of individuals, communities, and the planet? How can we invest in resilience and regeneration?). The sustainability research focuses on three overarching categories: thriving people, thriving planet, thriving public. The thematic map helps the External investment Manager to identify potential solutions to key sustainability challenges. Markers of companies leading the way and providing solutions include:

- Need: Is the solution meeting an identified need and contributing to a thriving world?
- Improvement: Does the solution offer meaningful benefits versus prior options?
- Advancing: Are the positive impacts increasing over time, through added scope, scale or performance?

## ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Effective: Can we identify meaningful positive impact for the company and beyond (customers, suppliers, and systems)?

The investment process is inclusionary, focused on identifying companies where excellence in sustainability (i.e., materiality map) is adding to long-term fundamental business prospects (i.e., thematic map).

The integrated research aims to identify two types of companies: sustainable leaders and sustainable solutions:

- Sustainable leaders are companies that have demonstrated leadership in the sustainability issues that are financially material to their businesses. The investment thesis is that companies that exhibit this type of commitment also often demonstrate potential for strong long-term financial performance.
- Sustainable solutions providers are companies whose products and services provide solutions to essential sustainability challenges. The belief is that solutions-oriented companies with potential to create positive social and environmental impact also demonstrate potential for strong growth and long-term financial performance.

Methodological limitations can be assessed in terms of nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%

## ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Exclusion of companies that do not pass the external investment manager's ESG suitability analysis. The External Investment Manager uses the data point from the external data provider Sustainalytics; the ESG Risk Rating. The rating is a single score, but it is composed of two main parts: "Exposure" measures a company's vulnerability or susceptibility to ESG risks. "Management" refers to actions taken by a company to manage a particular ESG issue. This can include a company's ESG issues and policies. Controversies can have a negative impact on a firm's management score because they often reveal that company initiatives were insufficient or ineffective. The ESG Risk Rating Assessment blends the exposure score and the management score together into a single score that tells how at risk a company's enterprise value is from ESG issues. The ratings sort companies into five risk categories: negligible, low, medium, high, severe. The External Investment Manager will not invest in companies rated as severe 10% of the global universe rated by Sustainalytics find themselves in the severe bucket. They are facing the highest level of material ESG risk.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its "Good Governance Policy", the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS "exclusion policy" are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

## ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus

**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.



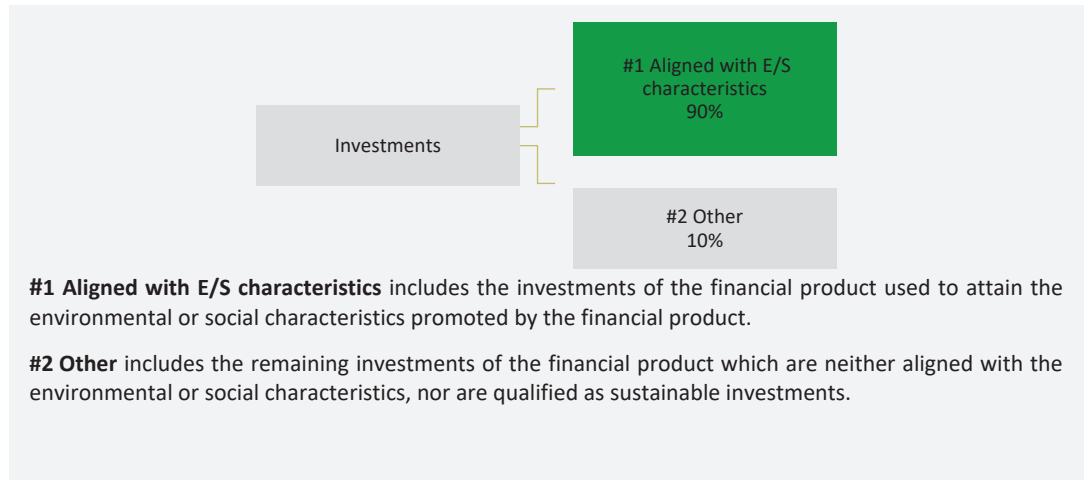
## ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.



**#1 Aligned with E/S characteristics** includes the investments of the financial product used to attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product.

**#2 Other** includes the remaining investments of the financial product which are neither aligned with the environmental or social characteristics, nor are qualified as sustainable investments.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

Yes:

In fossil gas

In nuclear energy

No

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

## ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?**

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***  
Not Applicable
- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***  
Not Applicable
- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***  
Not Applicable
- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***  
Not Applicable



**Where can I find more product specific information online?**

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html)  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- [Documents of the Sub-Fund:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html)  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

## ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

**Legal entity identifier:**

549300PX4Q6GP6GWDT19

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

### Does this financial product have a sustainable investment objective?



Yes



No



It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%



in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%



It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments



with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



with a social objective



It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-related Bonds (the “Sub-Fund”). The External Investment Manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Manager must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

## ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights and labour standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.

## ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company .

On the Sovereign side:

- Absence of countries that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions
- Investments in companies, government-related, and sovereign bonds with a positive or neutral SDG score based on the internally developed SDG Framework.

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

— ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

— ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

## ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

No



### What investment strategy does this financial product follow?

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

The Sub-Fund seeks to invest in investment grade euro denominated government-related bonds. ESG factors are incorporated in the decisions made in the investment process. The External Investment Manager uses three frameworks: the Fundamental Score framework, the SDG Framework and the Green Bonds Framework.

Sequencing starts with applying an SDG filter to the investment universe. Only the issuing entities (companies, government related entities, sovereigns) with a neutral or positive SDG score will be investable. The Country SDG Framework assesses (i) whether the policies of the country are advancing or detracting the UN SDGs, (ii) if a country lacks access to capital markets (iii) the controversies that the country might be involved in. On the corporate side, the Company SDG Framework is a 3-step analysis of a company’s contribution to the UN SDGs, which (i) assesses the impact of the company’s products on relevant SDGs, (ii) assesses the compatibility of the company’s operations with these SDGs, and (iii) monitors

## ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

controversies continuously. Both countries and companies are assigned an SDG Score ranging from -3 to +3. For Green, Social and Sustainable bonds the sequencing starts with the five-step eligibility process. Only the bond that have a positive score on each of these five criteria will be eligible for investment in the Sub-Fund.

After these eligibility checks, the selection process of the individual securities will take place. ESG is fully integrated into the fundamental bottom-up credit analysis conducted by the External Investment Manager to identify investment opportunities. When it comes to sovereign credit analyses, the External Investment Manager assigns each country with a Fundamental Score (*F-Score*), ranging from -3 to +3, that provides a detailed overview of the current developments in the country. The Country F-Score is calculated based on the Financial Health, Macroeconomic Cycle, and ESG profile of the country. The country ESG profile is based on the External Investment Manager Country Sustainability Ranking assessing the position of a country relative to other countries on 15 ESG criteria. For corporates, the External Investment Manager evaluates the issuer's cash generating capacity, its ability to repay debt, and the quality of its cash flows. ESG Factors are part of the overall analysis. Similar to countries, this assessment allows the External Investment Manager to assign each issuer with a Company F-Score ranging from -3 to +3.

Taking into account the Country and Corporate Fundamental Scores, the External Investment Manager constructs the portfolio.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
<b>Company Exclusions based on Revenue Thresholds</b>	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%



## ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>5%
Government Exclusions based on Norms and Policies	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes
Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The list above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Exclusion of the companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. The External Investment Manager considers for inclusion in the portfolio issuing entities with a neutral or positive SDG score.

- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

- ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

## ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

The good governance requirements outlined in the SFDR regulation are only applicable to investments in companies.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these

**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

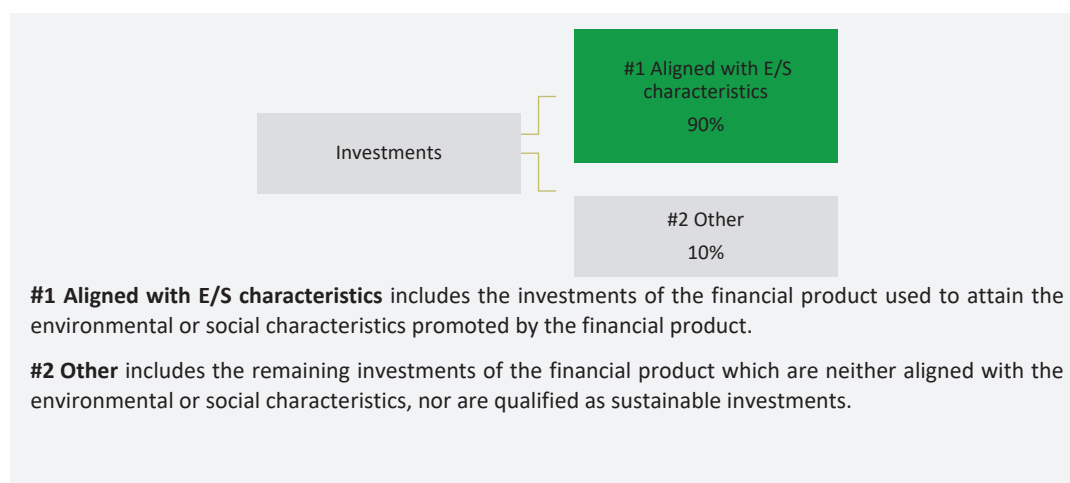
## ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>2</sup>?**

- Yes:
- In fossil gas  In nuclear energy
- No

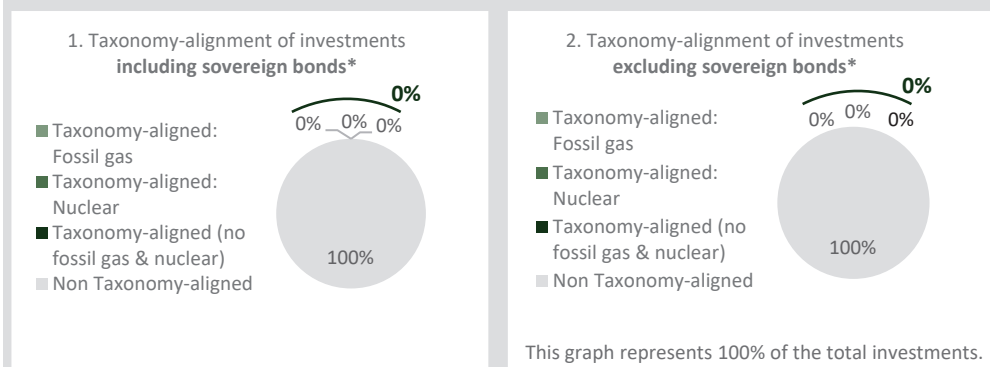
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

<sup>2</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

## ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?**

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



**Where can I find more product specific information online?**

*More product-specific information can be found on the websites:*

- *ABN AMRO Investment Solutions's Sustainable Investment Policy:*  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abnamro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- *Documents of the Sub-Fund:*  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities

**Legal entity identifier:**

549300XU783WQKIKOT55

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

## ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are leading or improving in ESG practices.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

## ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

Not Applicable

How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



## ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund aims to invest in emerging market equities. Consideration of ESG Factors is fully integrated into fundamental analysis and investment decisions. The external investment manager's fundamental analysis includes an assessment of ESG Factors, alongside other financial and operational characteristics. Following the ESG-related quality assessment, the external investment manager quantifies ESG risks for these companies, to determine whether these have been accounted for, in company's valuation. The external investment manager favors issuers with better ESG characteristics where this is not detrimental to the pursuit of the investment objective.

The Sub-Fund is managed through a fundamental, bottom-up/stock picking, and business-focused approach. The objective is to identify high quality growth companies that lead attractive growth industries. The investment process begins by assessing whether a company can meet the external investment manager's six investment criteria (namely: sustainable above-average earnings growth; leadership position in a promising business space; significant competitive advantages; clear mission and value-added focus; financial strength; and rational valuation relative to the market and business prospects). Based on this preliminary review, the eligible company is placed on the external investment manager new opportunities list. At this juncture, a coverage team is established, and the business becomes subject to a deep evaluation of all relevant financial and non-financial factors, including ESG (with a specific focus on Carbon emissions).

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>35%
Thermal Coal Extraction	>10%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Tobacco Producing Companies	>0%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the External Investment Manager ESG suitability analysis.

## ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

- **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

## ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The External Investment Manager will assess the good governance practices of portfolio companies which will involve assessing for issues relating to ownership and control, audit and accounting, board structure or composition, capital structure, executive compensation, employee relations, related-party transactions, shareholder protection and rights, management accountability, increasing transparency and disclosure, and the company's history of compliance with applicable regulations.



**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

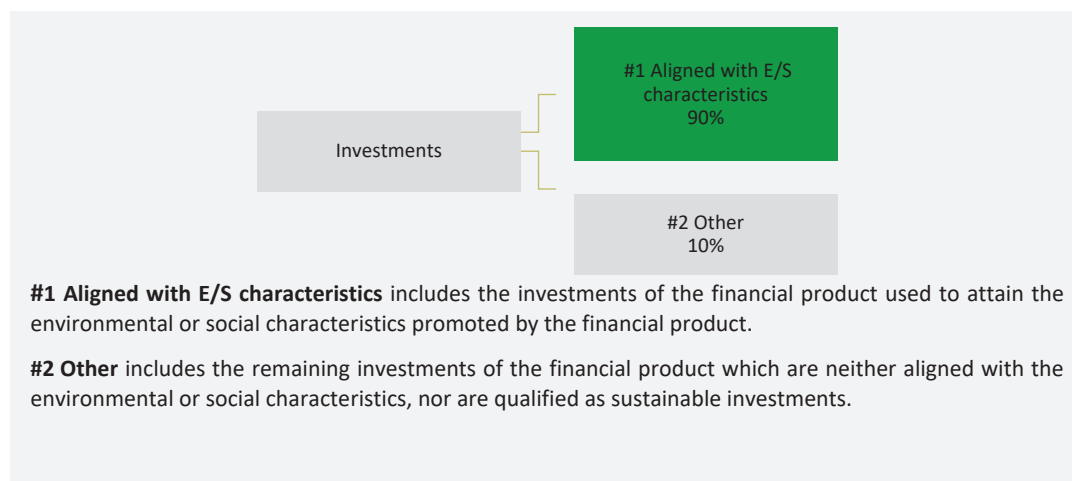
### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as "eligible" as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics)).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). "#2 Other" includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



### To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

## ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities

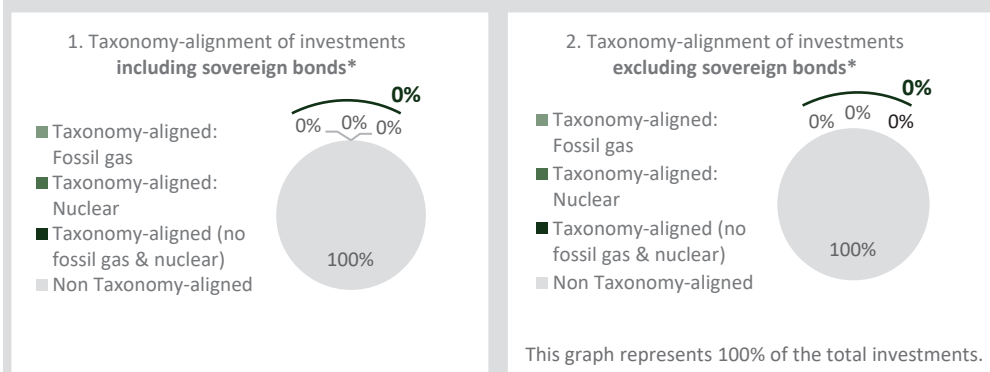
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

- Yes:
- In fossil gas     In nuclear energy
- No

*The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*




\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

 **What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

 **What is the minimum share of socially sustainable investments?**

Not Applicable

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

### Product name:

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds

### Legal entity identifier:

5493003TUGS6KJRX7279

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds (the "Sub-Fund"). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the "Management Company") ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

## ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

## ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes , the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



## ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund aims to provide medium term capital appreciation with a diversified and actively managed portfolio of euro corporate bonds. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The portfolio is actively managed through a process that combines a macro themes analysis and a bottom-up security selection. The outcome portfolio aims to combine uncorrelated sources of alpha in order to mitigate risk. The security selection process of the external investment manager incorporates a disciplined and well-defined ESG best-in-class approach. The external investment manager uses its proprietary ESG assessment analysis to identify leaders, laggards and issuers with highest ESG convictions.

For credit issuers in the portfolio analysts conduct both financial analysis and ESG analysis. In financial analysis, the external investment manager analyses companies' business models from a bottom-up perspective; revenues, cost, pricing power, capital allocation and leverage as well as liquidity management play a central role. That combined with sectorial and thematic considerations drive the financial credit recommendations and positioning in the fund. Governance and management quality assessment as well as ESG risk considerations (regulation/ stranded asset/ bad governance etc) affect both fundamental and ESG analysis. Analysts express their views with a rating from 1-Improving to 4-Deteriorating.

In addition, analysts use their internal proprietary tool SustainEx to get an estimate of various social and environmental "costs" or "benefits" of companies, by using certain indicators and quantifying them positively (e.g., medicine provisions, connectivity) and negatively (e.g., water intensity, CO2 emissions) to produce an aggregate notional measure of the effect that the relevant underlying issuer has on society and the environment.

Engagement with companies is a part of the ESG analysis and fund positioning and can also be relevant for financial materiality on the fundamental side.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- **What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%

## ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. The External Investment Manager will consider for inclusion into the portfolio of the Sub-Fund, companies with the top 80% ESG scores (taking the External Investment Manager's proprietary scoring methodology).

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its "Good Governance Policy", the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS "exclusion policy" are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

## ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

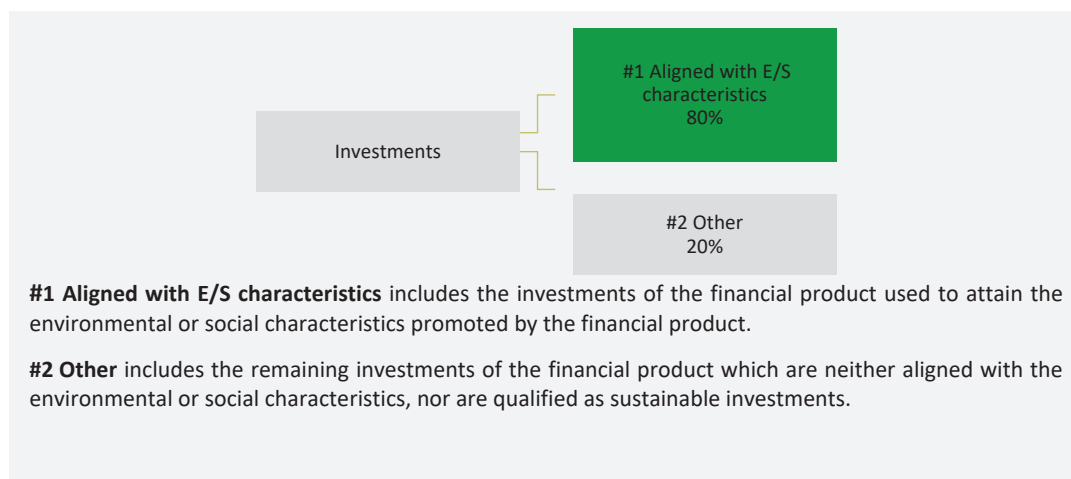
## ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

Yes:

In fossil gas

In nuclear energy

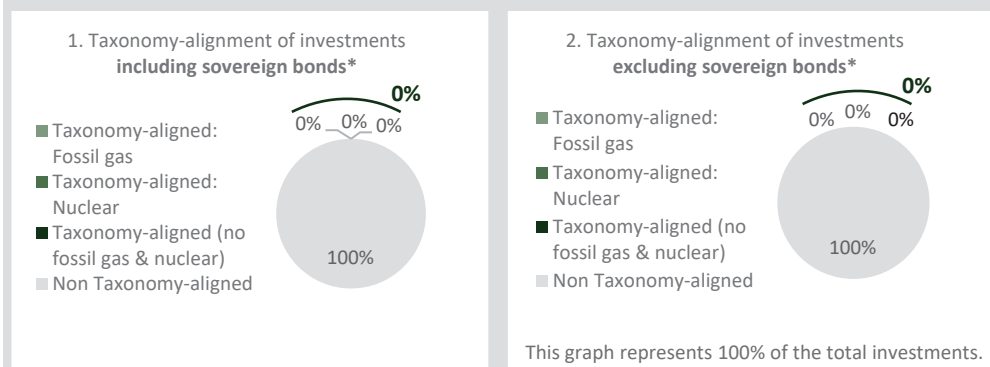
No

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

## ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?**

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***  
Not Applicable
- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***  
Not Applicable
- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***  
Not Applicable
- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***  
Not Applicable



**Where can I find more product specific information online?**

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html)  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- [Documents of the Sub-Fund:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html)  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

## ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

**Legal entity identifier:**

549300FC4BSAZ6UXCV90

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

### Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds (the "Sub-Fund"). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the "Management Company") ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

## ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.



## ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

**How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

**How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes , the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

## ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund aims to provide medium term capital appreciation with a diversified and actively managed portfolio of euro corporate bonds. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The portfolio is actively managed through a process that combines a macro themes analysis and a bottom-up security selection. The outcome portfolio aims to combine uncorrelated sources of alpha in order to mitigate risk. The security selection process of the external investment manager incorporates a disciplined and well-defined ESG best-in-class approach. The external investment manager uses its proprietary ESG assessment analysis to identify leaders, laggards and issuers with highest ESG convictions.

For credit issuers in the portfolio analysts conduct both financial analysis and ESG analysis. In financial analysis, the external investment manager analyses companies' business models from a bottom-up perspective; revenues, cost, pricing power, capital allocation and leverage as well as liquidity management play a central role. That combined with sectorial and thematic considerations drive the financial credit recommendations and positioning in the fund. Governance and management quality assessment as well as ESG risk considerations (regulation/ stranded asset/ bad governance etc) affect both fundamental and ESG analysis. Analysts express their views with a rating from 1-Improving to 4-Deteriorating.

In addition, analysts use their internal proprietary tool SustainEx to get an estimate of various social and environmental "costs" or "benefits" of companies, by using certain indicators and quantifying them positively (e.g., medicine provisions, connectivity) and negatively (e.g., water intensity, CO2 emissions) to produce an aggregate notional measure of the effect that the relevant underlying issuer has on society and the environment.

Engagement with companies is a part of the ESG analysis and fund positioning and can also be relevant for financial materiality on the fundamental side.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

For information, the Sub-Fund will aim to lower the duration by an equivalent of the duration of its Reference Portfolio using listed derivatives.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No

## ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. The External Investment Manager will consider for inclusion into the portfolio of the Sub-Fund, companies with the top 80% ESG scores (taking the External Investment Manager’s proprietary scoring methodology).

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

## ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

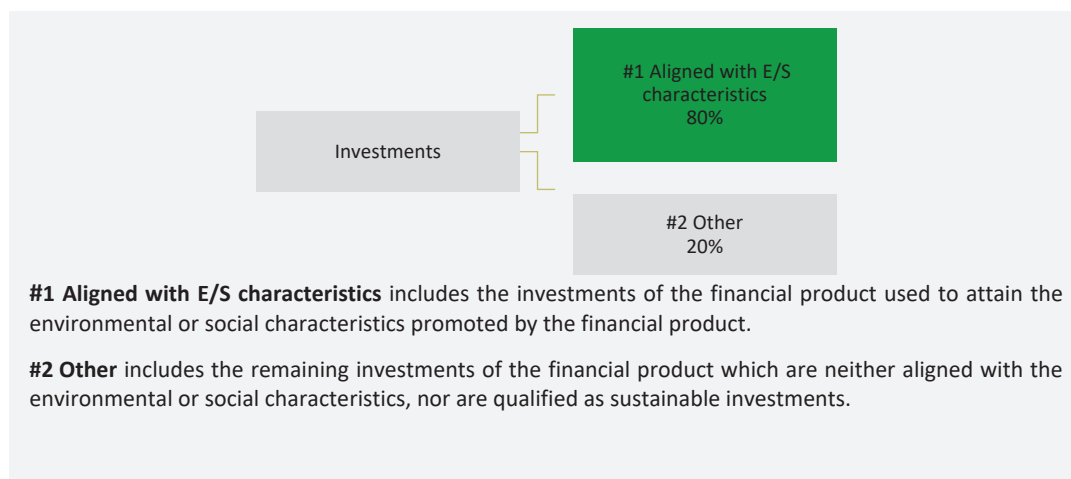
## ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.



**#1 Aligned with E/S characteristics** includes the investments of the financial product used to attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product.

**#2 Other** includes the remaining investments of the financial product which are neither aligned with the environmental or social characteristics, nor are qualified as sustainable investments.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

Yes:

In fossil gas

In nuclear energy

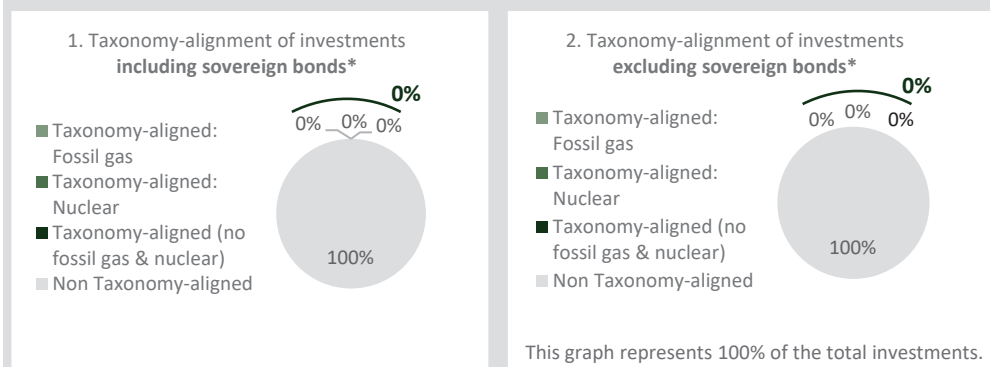
No

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### ● What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

## ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?**

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



**Where can I find more product specific information online?**

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities

**Legal entity identifier:**

549300ZHDE6PGNUEWN16

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

### Does this financial product have a sustainable investment objective?



Yes



No



It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%



in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%



It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments



with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



with a social objective



It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall



## ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

## ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

Not Applicable

How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

## ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

The External Investment Manager's process focuses on all factors that influence the company's long-term performance, including ESG factors. The External Investment Manager's approach to ESG integration is to ensure that material factors relating to a company's integrity, sustainability and governance are integrated into the investment process (both analysis and decision-making). The objective of integrating ESG factors into the External Investment Manager's approach is to provide enhanced risk-adjusted returns over the long term. The External Investment Manager's "7 Sisters" model includes an analysis of an issuer's business operations and its interactions with key stakeholders, and is integrated into the financial management of the portfolio to enable the fund manager to identify the risks as well as the opportunities that arise from the key sustainability challenges.

The "Seven Sisters" model is based around:

- Company – History, business, divisional/geographic split, customer examples, operational footprint
- Integrity – Summary of the Integrity, Sustainability and Governance analysis.
- Market Characteristics – Size/growth/cyclicality/structure and regulation
- Control of Destiny – Market share and competitors, are they a consolidator, competitive advantage and barriers to entry, pricing power, customer/supplier concentration, substitution risk
- Financial Profile – Looks at the return structure, cash flow and the balance sheet.
- Management & Board – Experience and longevity, diversity, remuneration issues
- Valuation/Trading – Valuation, size/liquidity, available share classes.

In the analysis of integrity, sustainability and governance practices, companies are assessed and monitored on relevant and material factors across four key areas:

- 1) Environmental Considerations
- 2) Carbon Risk and Climate Change
- 3) Human and Social Capital
- 4) Governance

Engagement is central to the process. The External Investment Manager actively engages with investee companies for information and for change, addressing ESG and other issues that are material to the companies' long-term success.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

## ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- As part of the ESG inclusion selection process of the External investment Manager, are eligible for investment companies that score within the first 80% of the universe as defined by the External investment Manager ESG scoring methodology.
- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

## ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

### ● *What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?*

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

The External Investment Manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. The External Investment Manager only invests in companies considered having high standards of governance looking at its proprietary methodology. Companies are assessed and monitored across governance factors

## ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

considered material to their operations. These may include board diversity, board skills and experience, board independence, succession planning, executive remuneration, employee relations, tax compliance, shareholder protection and rights, insider selling, related party transactions, uncancelled treasury stock as well as poison pills, as part of the fundamental analysis performed. Further, specific analysis of certain factors is carried out, supported with data points from a third-party provider and internally set thresholds.



**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

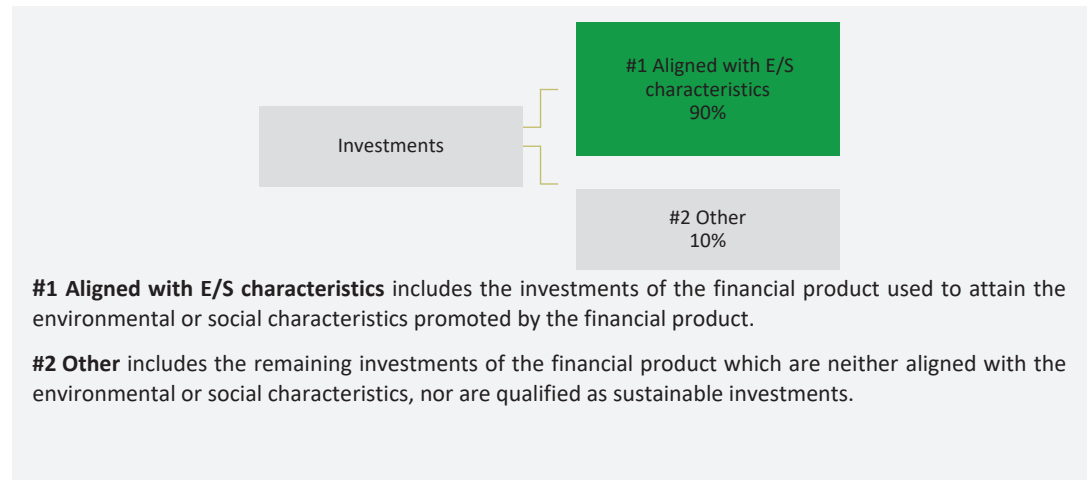
### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



### To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

## ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities

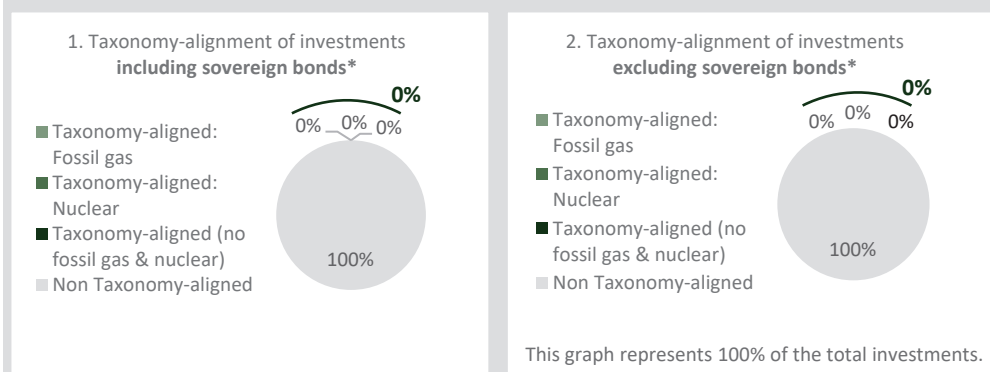
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

### Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?

- Yes:
- In fossil gas  In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.



## ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

**Legal entity identifier:**

549300BP04XA5GEJQV74

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Fund of Mandate Euro Corporate Bonds (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary.

## ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

### ● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

## ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

**How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

**How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



**Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?**

Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

## ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
<b>Company Exclusions based on Revenue Thresholds</b>	
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>35%
Thermal Coal Extraction	>10%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Tobacco Producing Companies	>0%

## ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.

## ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

The good governance requirements outlined in the SFDR are only applicable to investments in companies.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments may not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes external funds, ETF, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.

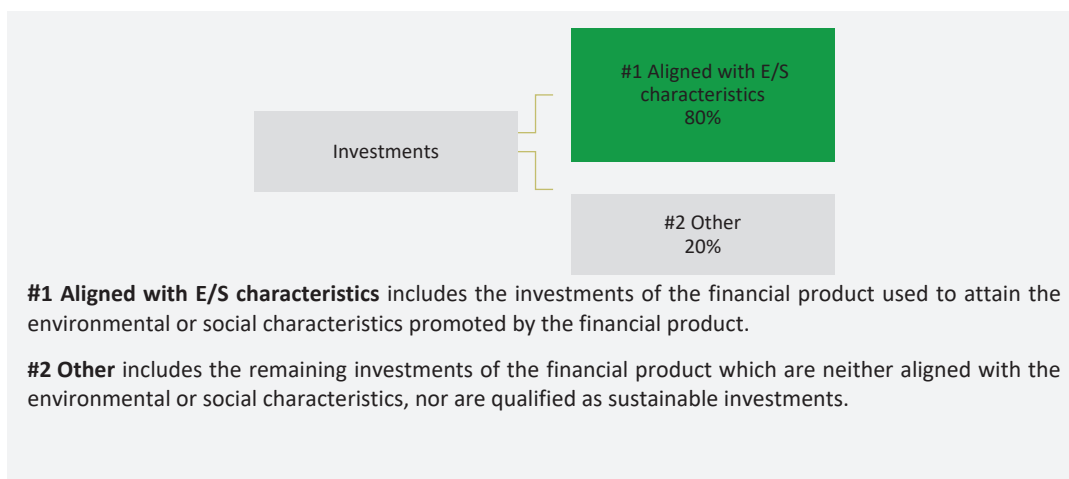
**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

## ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

Yes:

In fossil gas

In nuclear energy



No

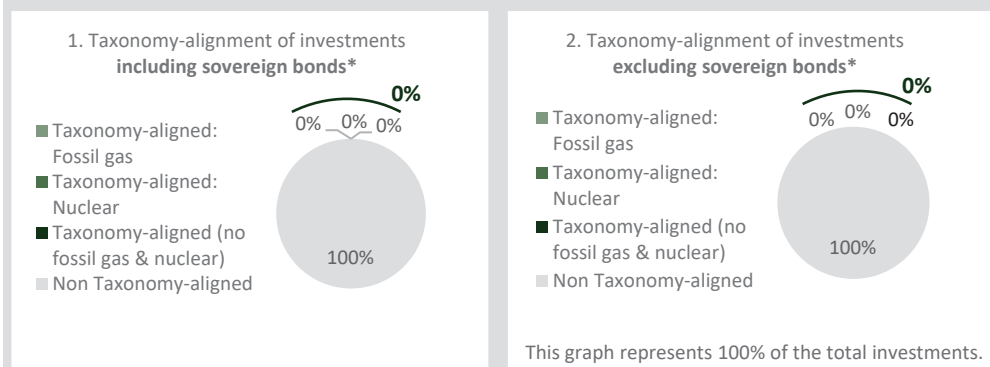
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes external funds, ETF, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



## ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?**

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



**Where can I find more product specific information online?**

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

### Product name:

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged

### Legal entity identifier:

549300S56ZBDSKD7LU52

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

### Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Fund of Mandate Euro Corporate Bonds (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary.

## ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

### ● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

## ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

**How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

**How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



**Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?**

Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

## ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

For information, the Sub-Fund will aim to lower the duration by an equivalent of the duration of its Reference Portfolio using listed derivatives.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No

## ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>35%
Thermal Coal Extraction	>10%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Tobacco Producing Companies	>0%

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

## ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

The good governance requirements outlined in the SFDR are only applicable to investments in companies.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments may not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes external funds, ETF, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.

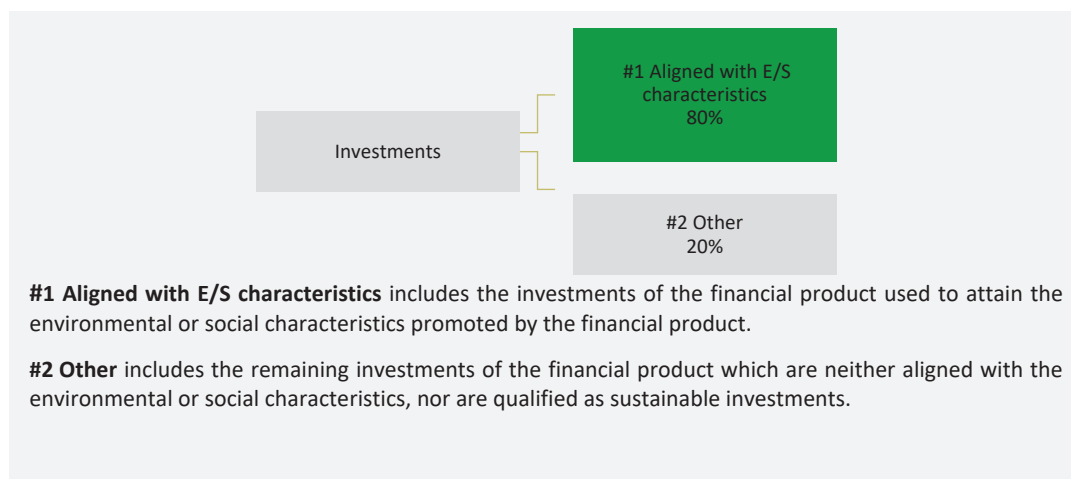
**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

## ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

Yes:

In fossil gas

In nuclear energy

No

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

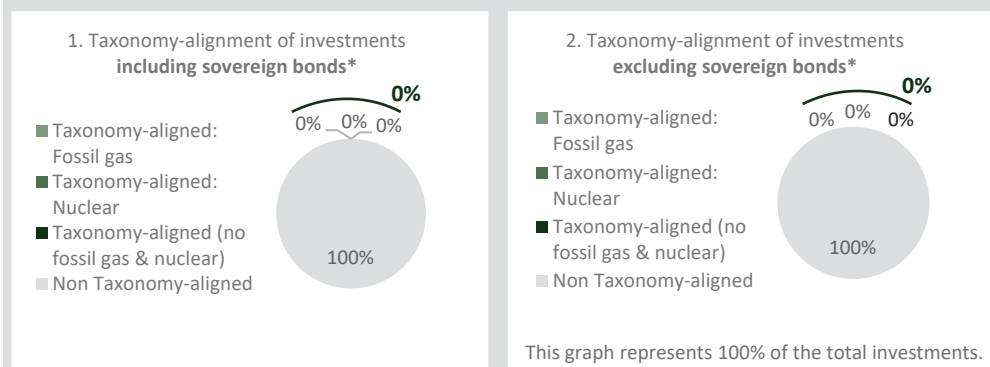
<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.



## ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes external funds, ETF, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

## ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?**

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.



**Where can I find more product specific information online?**

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html)  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>

- [Documents of the Sub-Fund:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html)  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

## ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds

**Legal entity identifier:**

549300RYVVF8K73H3B285

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

### Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social

## ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)

## ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

— ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

— ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

## ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>35%
Thermal Coal Extraction	>10%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Tobacco Producing Companies	>0%
Government Exclusions based on Norms and Policies	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes
Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU)2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.
- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

- ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its "Good Governance Policy", the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS "exclusion

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

## ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these

**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.



## ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds

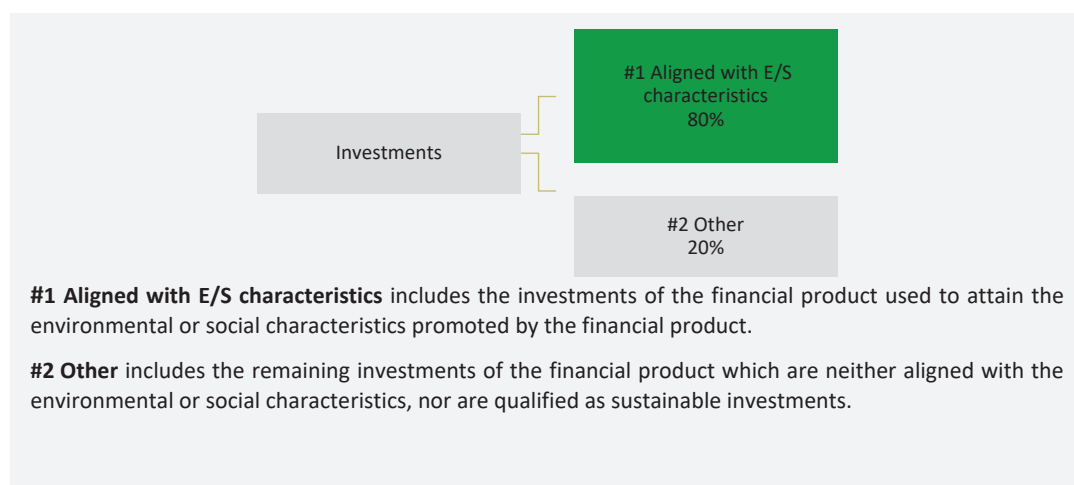
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

Yes:
   
      In fossil gas     In nuclear energy

No

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

## ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?**

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***  
Not Applicable
- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***  
Not Applicable
- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***  
Not Applicable
- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***  
Not Applicable



**Where can I find more product specific information online?**

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

## ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

**Legal entity identifier:**

549300GZOXFZT0HYCP85

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social

## ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)

## ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

— ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

— ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

## ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%
Government Exclusions based on Norms and Policies	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes
Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU)2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.



## ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

● **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

The delegated external investment managers selected by the Management Company are committed to apply a selectivity rate of at least 20 %.

● **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

## ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

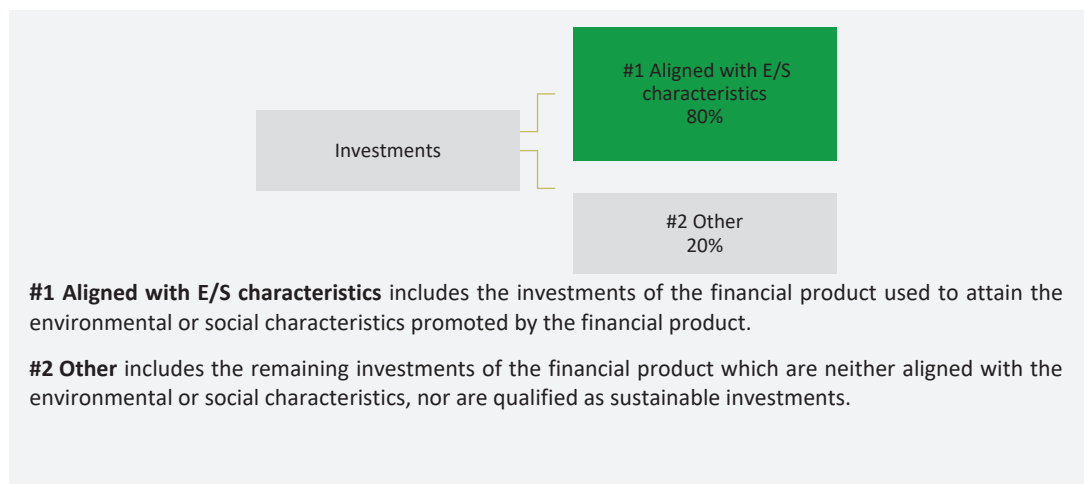
### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



### ● *How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?*

Not Applicable



### **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

## ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

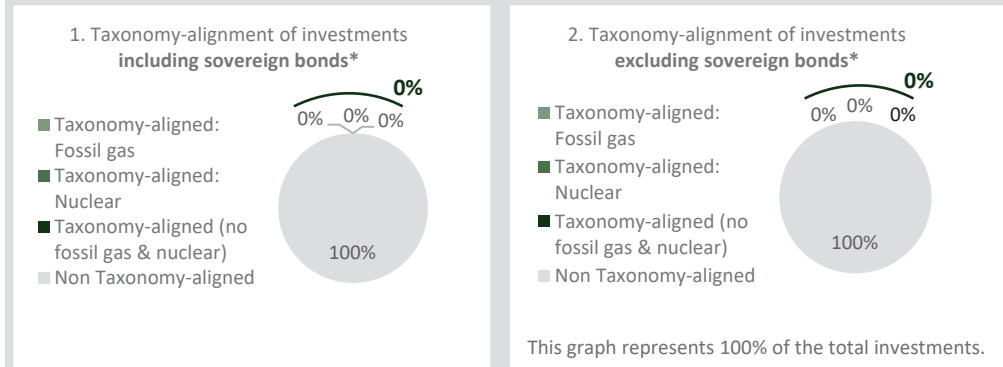
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

### Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?

- Yes:
- In fossil gas  In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive

**Legal entity identifier:**

549300C3K73QSZVYCC61

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

### Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio will be

## ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

composed of issuers that are leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG best-practice.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy.. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualifies as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company (i.e., applicable only to direct investments).

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.



## ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%
Government Exclusions based on Norms and Policies	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes
Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

The delegated external investment managers selected by the Management Company are committed to apply a selectivity rate of at least 20 %.

- **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

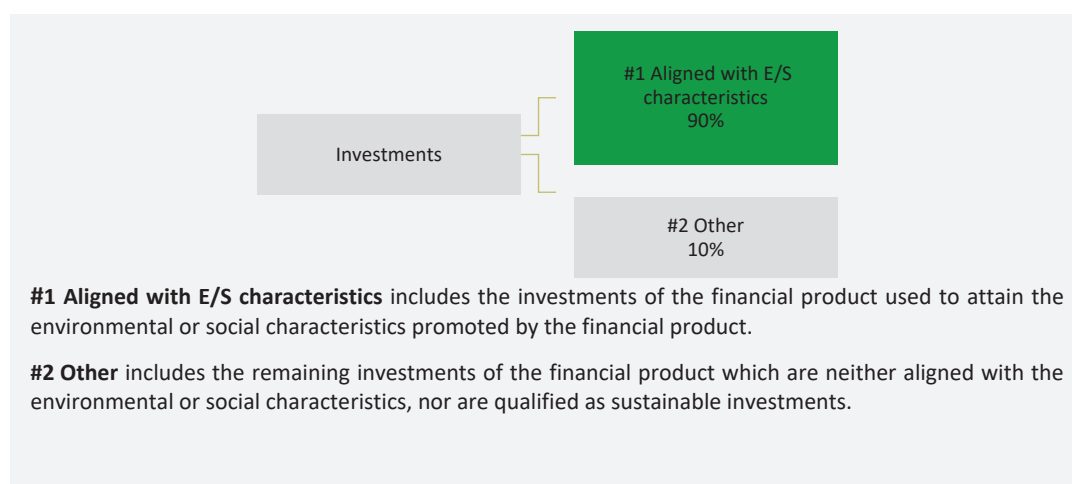


**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Consequently, up to 10% of the investments may not be aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



### To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive

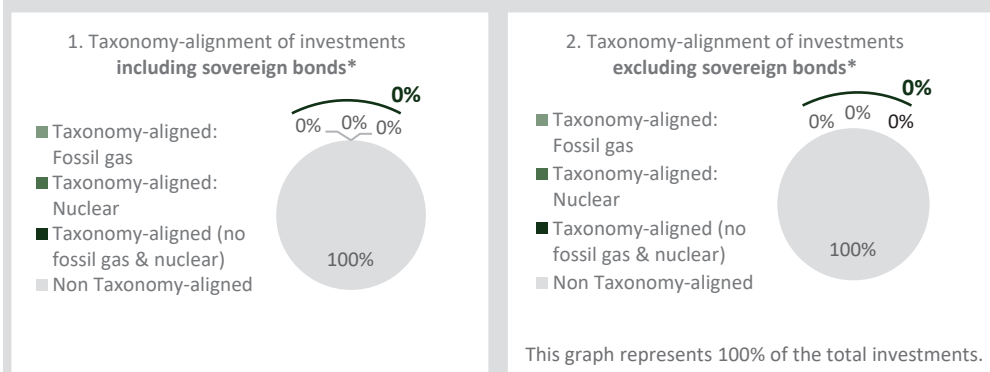
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

### Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?

- Yes:
- In fossil gas  In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html):  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- [Documents of the Sub-Fund](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html):  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive

**Legal entity identifier:**

549300TMQ3X206QAK130

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance

## ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

(ESG) responsibility criteria. The portfolio will be composed of issuers that are leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG best-practice.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



## ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy.. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualifies as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company (i.e., applicable only to direct investments).

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company’s exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact’s Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%
Government Exclusions based on Norms and Policies	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes
Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

The delegated external investment managers selected by the Management Company are committed to apply a selectivity rate of at least 20 %.

- **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

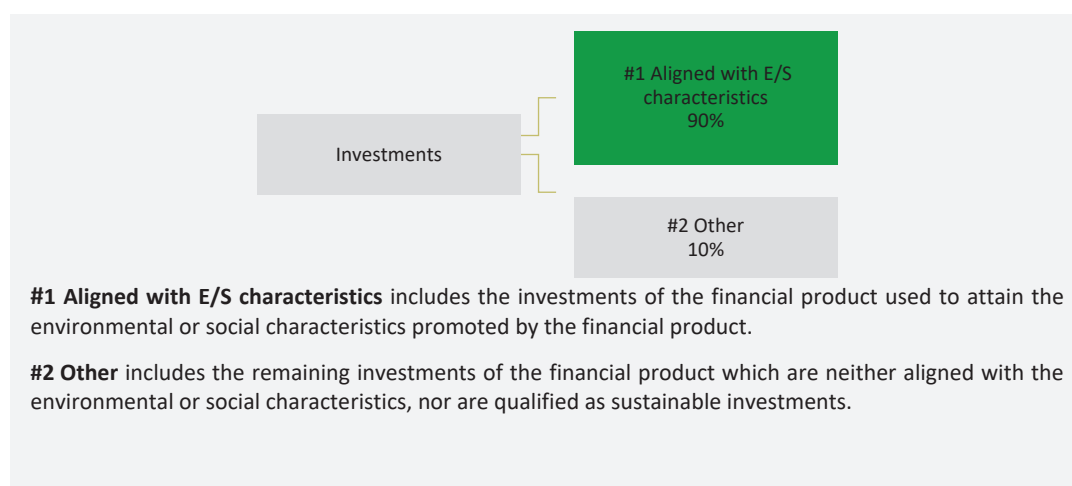


**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Consequently, up to 10% of the investments may not be aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



**#1 Aligned with E/S characteristics** includes the investments of the financial product used to attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product.

**#2 Other** includes the remaining investments of the financial product which are neither aligned with the environmental or social characteristics, nor are qualified as sustainable investments.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



### To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive

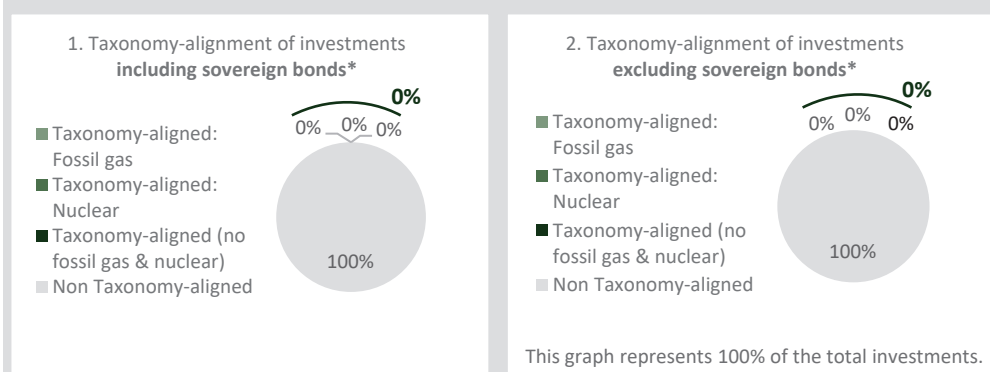
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

### Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?

- Yes:
- In fossil gas  In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html):  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- [Documents of the Sub-Fund](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html):  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive

**Legal entity identifier:**

549300I5C5D9HO34B644

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio will be

## ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

composed of issuers that are leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG best-practice.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.



## ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy.. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualifies as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company (i.e., applicable only to direct investments).

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%
Government Exclusions based on Norms and Policies	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes
Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

● **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

The delegated external investment managers selected by the Management Company are committed to apply a selectivity rate of at least 20 %.

● **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

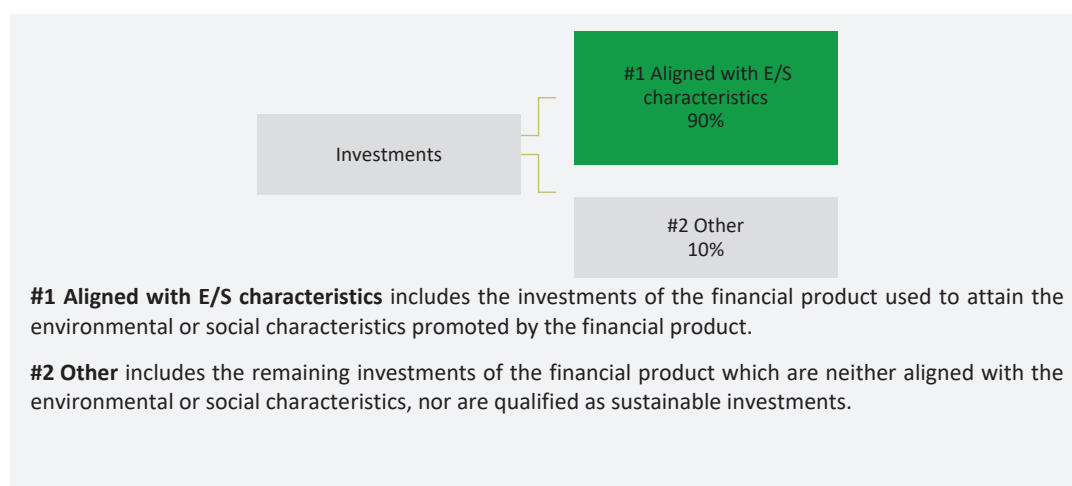


**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Consequently, up to 10% of the investments may not be aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

## ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive

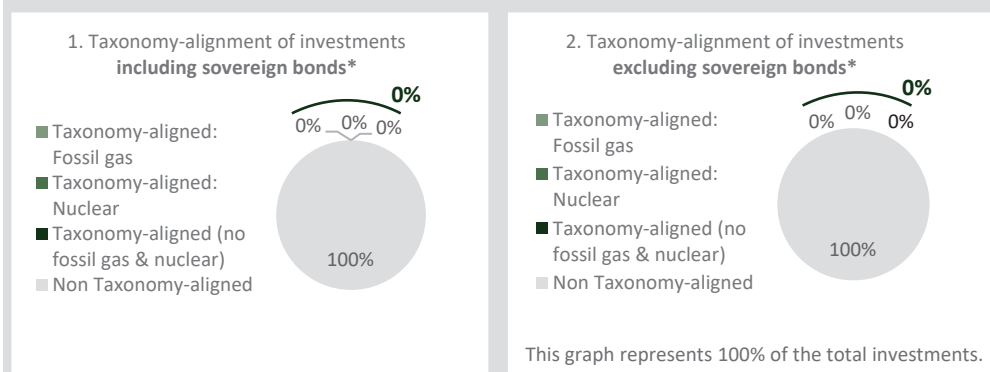
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

- Yes:
- In fossil gas     In nuclear energy
- No

*The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*




\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

 **What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

 **What is the minimum share of socially sustainable investments?**

Not Applicable

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive

**Legal entity identifier:**

54930043ILLLOXDPKX02

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio will be



## ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

composed of issuers that are leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG best-practice.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

— ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

— ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy.. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualifies as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company (i.e., applicable only to direct investments).

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company’s exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact’s Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%
Government Exclusions based on Norms and Policies	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes
Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

● **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

The delegated external investment managers selected by the Management Company are committed to apply a selectivity rate of at least 20 %.

● **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

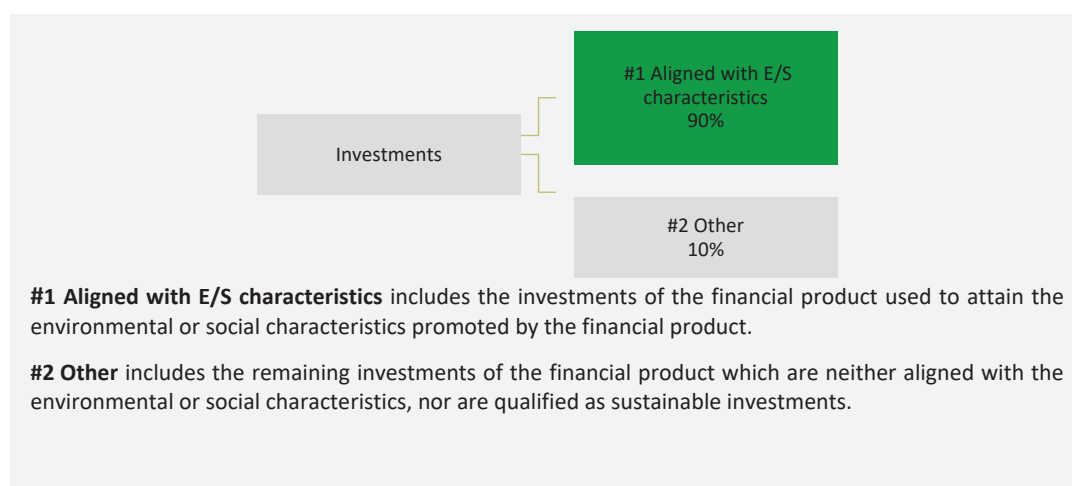


**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Consequently, up to 10% of the investments may not be aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

## ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive

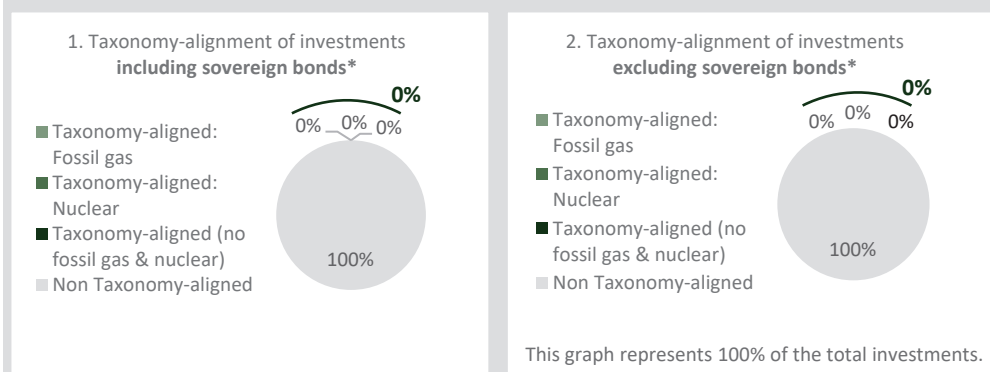
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

- Yes:
- In fossil gas     In nuclear energy
- No

*The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*




\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

 **What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

 **What is the minimum share of socially sustainable investments?**

Not Applicable

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html):  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- [Documents of the Sub-Fund](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html):  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.



## ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds ESG Profile 5 –Aggressive

**Legal entity identifier:**

549300BW18Q0DX4OG435

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds ESG Profile 5 –Aggressive (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance

## ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

(ESG) responsibility criteria. The portfolio will be composed of issuers that are leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG best-practice.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy.. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualifies as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company (i.e., applicable only to direct investments).

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company’s exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact’s Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%
Government Exclusions based on Norms and Policies	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes
Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

The delegated external investment managers selected by the Management Company are committed to apply a selectivity rate of at least 20 %.

- **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

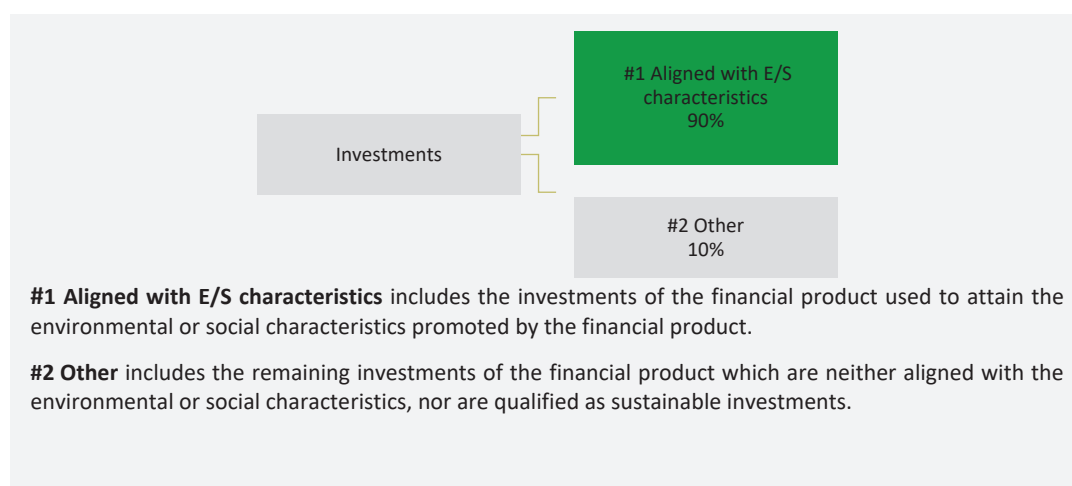


**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Consequently, up to 10% of the investments may not be aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



### To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

## ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive

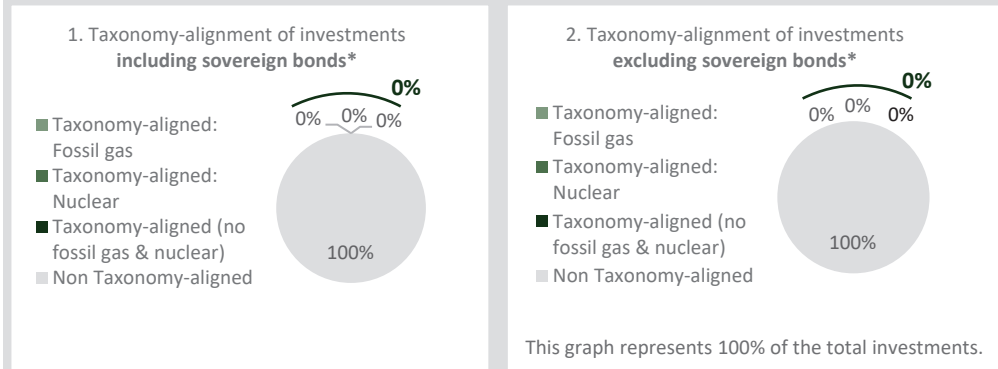
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

- Yes:
- In fossil gas     In nuclear energy
- No

*The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



**What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable



**What is the minimum share of socially sustainable investments?**

Not Applicable

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.



## ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html):  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>

- [Documents of the Sub-Fund](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html):  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive

**Legal entity identifier:**

549300VPXLHR3PBY3M74

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

### Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio will be

## ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

composed of issuers that are leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG best-practice.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

— ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

— ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy.. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualifies as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company (i.e., applicable only to direct investments).

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company’s exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact’s Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%
Government Exclusions based on Norms and Policies	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes
Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

● **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

The delegated external investment managers selected by the Management Company are committed to apply a selectivity rate of at least 20 %.

● **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

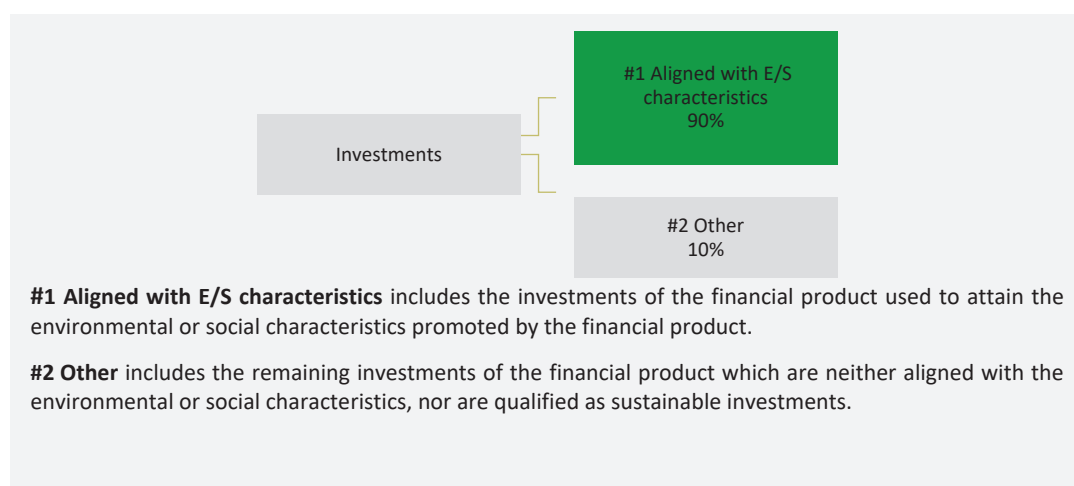


**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Consequently, up to 10% of the investments may not be aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



### To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



## ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

### Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?

- Yes:
- In fossil gas  In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds Global Balanced

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Global Balanced

**Legal entity identifier:**

549300UXIM8KV62VED10

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Global Balanced (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social

## ABN AMRO Funds Global Balanced

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)

## ABN AMRO Funds Global Balanced

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

— ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

— ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

## ABN AMRO Funds Global Balanced

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

**x** Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

**□** No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

To select eligible securities, the Management Company performs both a financial and non-financial analysis, using ESG criteria in combination with exclusions filters.

The process of selecting the eligible securities starts with applying quantitative screens on a global universe by using the external ESG data provider Sustainalytics. These screens consist of activity-based and norm-based exclusions and ESG risk scores classification.

The purpose of the negative filters is to eliminate from investment companies that violate international standards, activities that might have a negative effect on society and on environment (as tobacco and thermal coal). The Management Company will then rank the securities according to their ESG risk score as evaluated by Sustainalytics. The purpose of the ranking is to better allocate the ESG risk score in the portfolio. The Management Company will only retain securities with an ESG risk score that is either negligible, low, medium or high. Investing in severe ESG risk score (>40) is not allowed.

Moreover, as part of the controversy assessment and using Sustainalytics as the data source provider, the Management company will exclude companies with the highest controversy score (i.e level 5-severe out of 6 levels from 0 to 5).

The Management Company may invest in external or internal funds to expose the Sub-Fund on specific market (as emerging markets, for example). Those investment funds promote environmental and social characteristics and qualifies as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector ("SFDR Article 8") or contributes to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector ("SFDR article 9"). External investment funds are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes to the capabilities in place and the portfolio construction. External

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds Global Balanced

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the “Sustainability Investment Policy” of the Management Company (i.e., applicable only to direct investments).

The management team will select the securities within the eligible universe as filtered above and will construct the portfolio based on financial criteria (top-down and bottom up) to attain the financial objectives of the fund.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company’s exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact’s Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>35%
Thermal Coal Extraction	>10%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Tobacco Producing Companies	>0%
Government Exclusions based on Norms and Policies	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes
Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Management Company ESG suitability criteria for investments as defined below:
  - o direct investments: only securities with an ESG risk score below 40 are eligible and a controversy level of 5 (or “severe”) based on Sustainalytics data.
  - o indirect investments: investment funds that promote environmental and social characteristics and qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or that contribute to

## ABN AMRO Funds Global Balanced

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

environmental and social objectives and qualify as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services.

● **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

● **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.



## ABN AMRO Funds Global Balanced

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

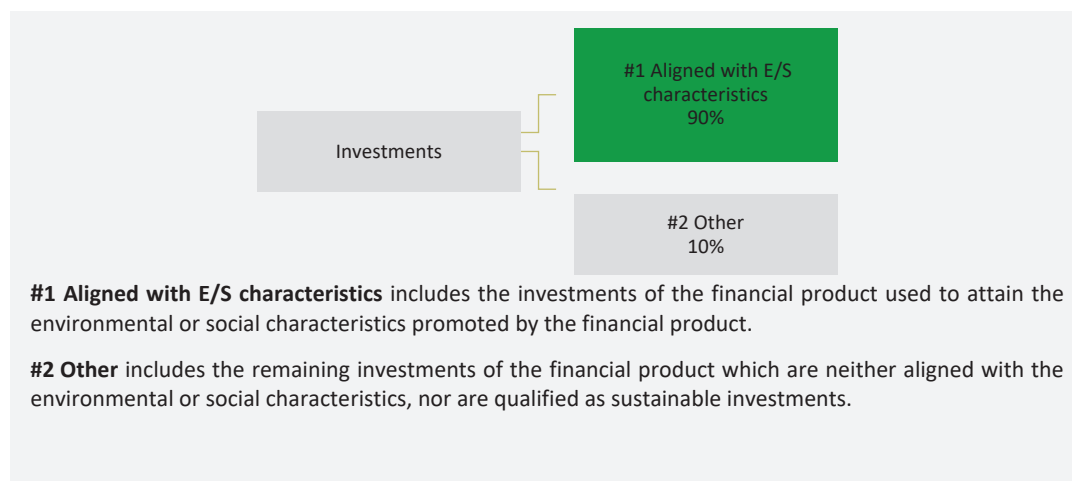
The good governance requirements outlined in the SFDR regulation are only applicable to investments in companies. Nonetheless, the external investment manager has in place a good governance methodology when it comes to consider emerging markets state-owned companies, sovereign agencies and sovereigns.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes other funds (inc.ETF) that do classify as “SFDR Article 8” or “SFDR article 9”, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



**To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

## ABN AMRO Funds Global Balanced

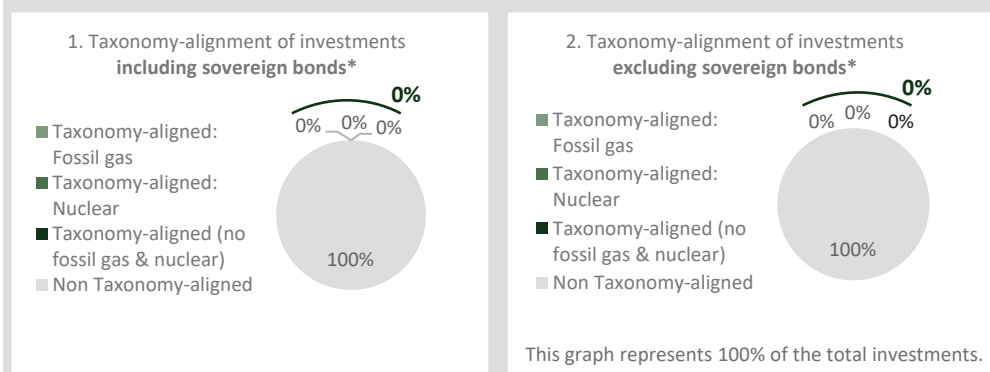
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

- Yes:
- In fossil gas     In nuclear energy
- No

*The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*




\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

 **What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

 **What is the minimum share of socially sustainable investments?**

Not Applicable

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Global Balanced

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes other funds (inc.ETF) that do not classify “SFDR Article 8” or “SFDR article 9”, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html):  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- [Documents of the Sub-Fund](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html):  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

## ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

**Legal entity identifier:**

549300XT2IJ8JRX6BR14

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social

## ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

## ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

**How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

**How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



**Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?**

Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

## ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

### What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
<b>Company Exclusions based on Revenue Thresholds</b>	
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>35%
Thermal Coal Extraction	>10%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Tobacco Producing Companies	>0%

## ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.



## ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes external funds, ETF, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

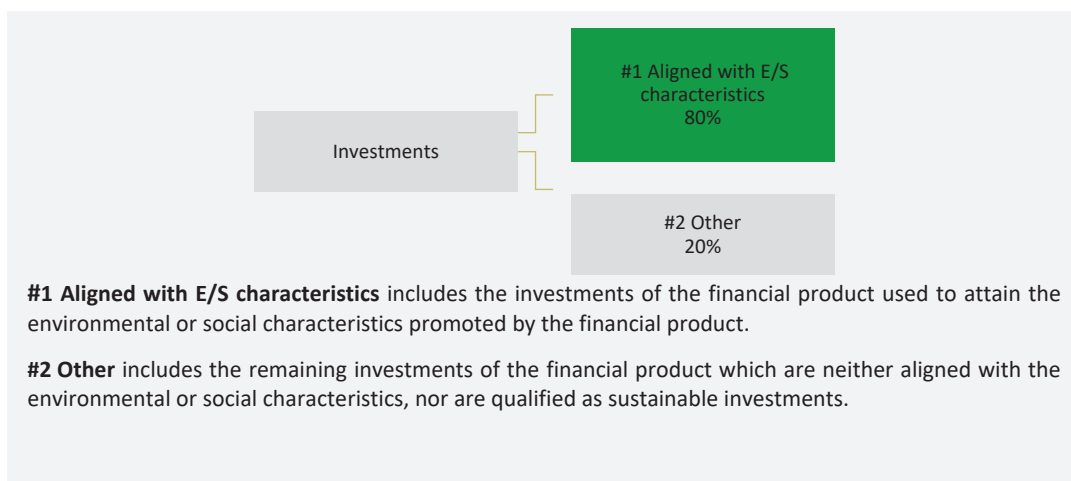
**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

## ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



**#1 Aligned with E/S characteristics** includes the investments of the financial product used to attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product.

**#2 Other** includes the remaining investments of the financial product which are neither aligned with the environmental or social characteristics, nor are qualified as sustainable investments.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

Yes:

In fossil gas

In nuclear energy

No

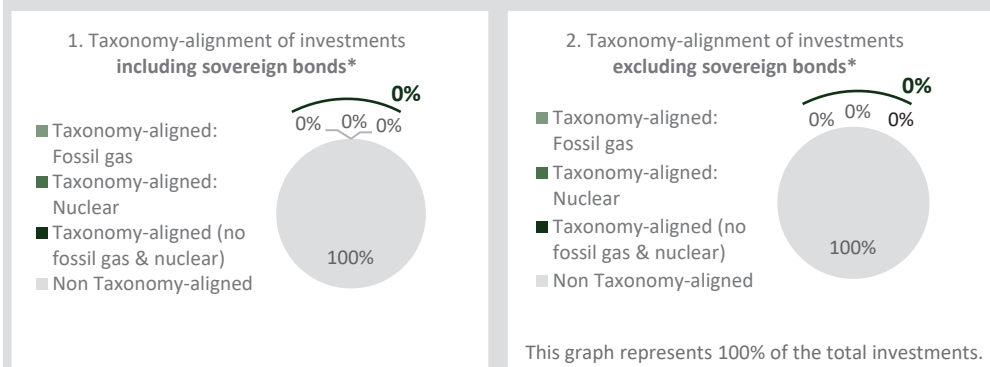
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes external funds, ETF, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

## ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?**

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***  
Not Applicable
- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***  
Not Applicable
- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***  
Not Applicable
- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***  
Not Applicable



**Where can I find more product specific information online?**

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html)  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- [Documents of the Sub-Fund:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html)  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

## ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

**Legal entity identifier:**

549300AC8R4PL0KWIO56

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities (the "Sub-Fund"). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the "Management Company") ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio will be

## ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

composed of issuers that are leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG best-practice.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

## ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

## ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy.. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualifies as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company (i.e., applicable only to direct investments).

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.



## ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%
Government Exclusions based on Norms and Policies	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes
Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

## ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

● **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.

## ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.

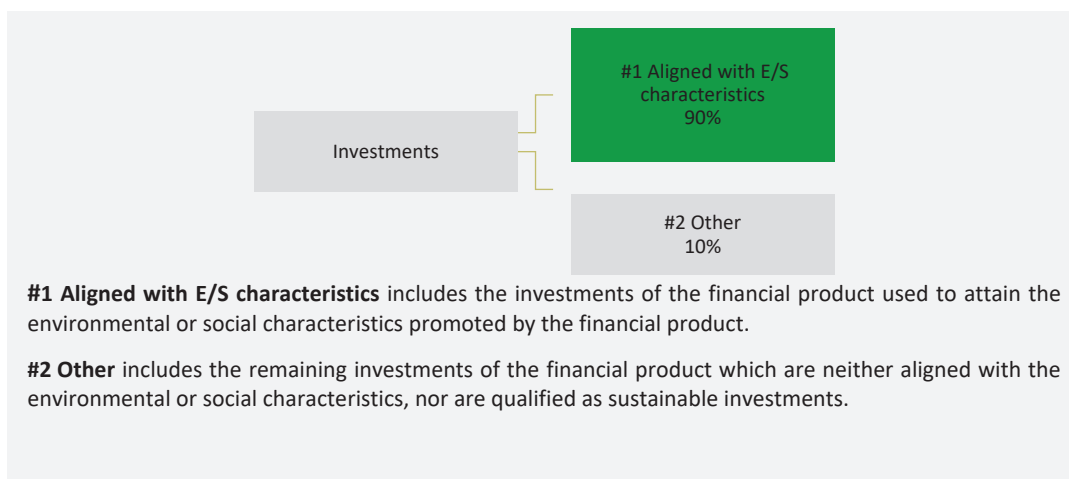
**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

## ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



**#1 Aligned with E/S characteristics** includes the investments of the financial product used to attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product.

**#2 Other** includes the remaining investments of the financial product which are neither aligned with the environmental or social characteristics, nor are qualified as sustainable investments.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

Yes:

In fossil gas

In nuclear energy



No

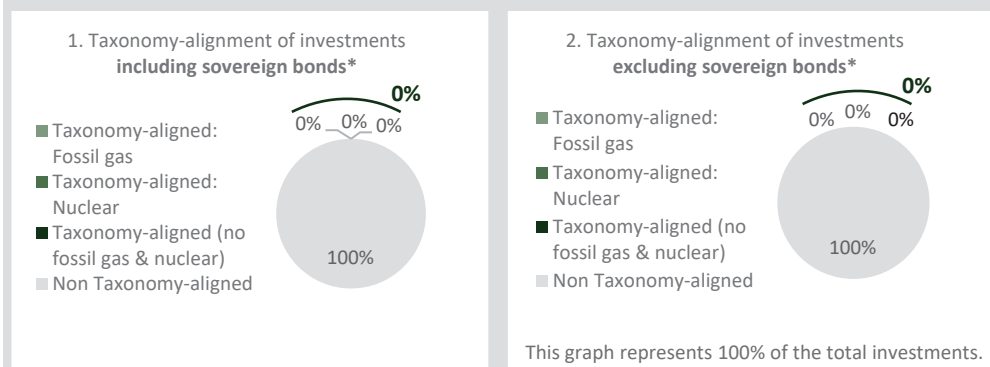
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

## ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?**

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***  
Not Applicable
- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***  
Not Applicable
- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***  
Not Applicable
- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***  
Not Applicable



**Where can I find more product specific information online?**

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds

**Legal entity identifier:**

549300MYXDZGOJ2JCD51

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)



## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

— ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

— ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company’s exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact’s Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>35%
Thermal Coal Extraction	>10%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Tobacco Producing Companies	>0%
Government Exclusions based on Norms and Policies	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes
Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.
- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

- ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.



### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes external funds, ETF, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

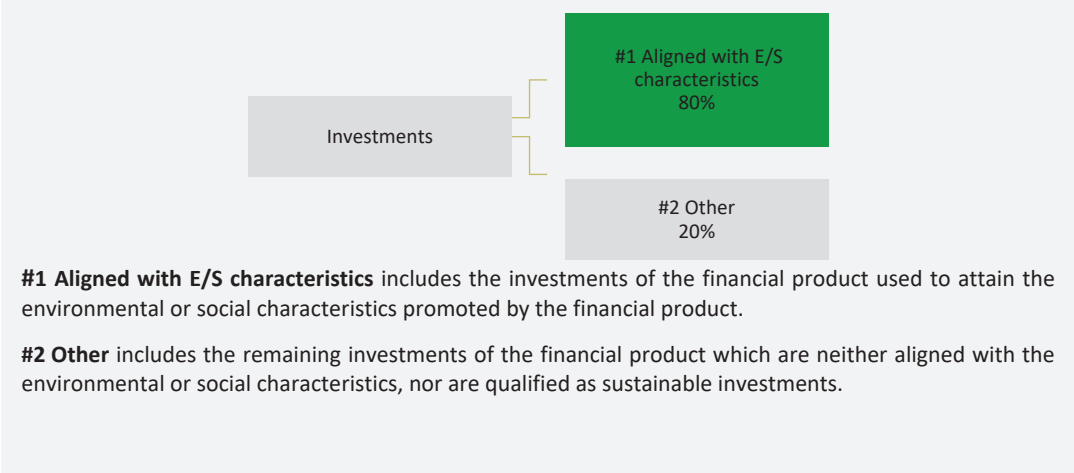
**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

Yes:

In fossil gas     In nuclear energy

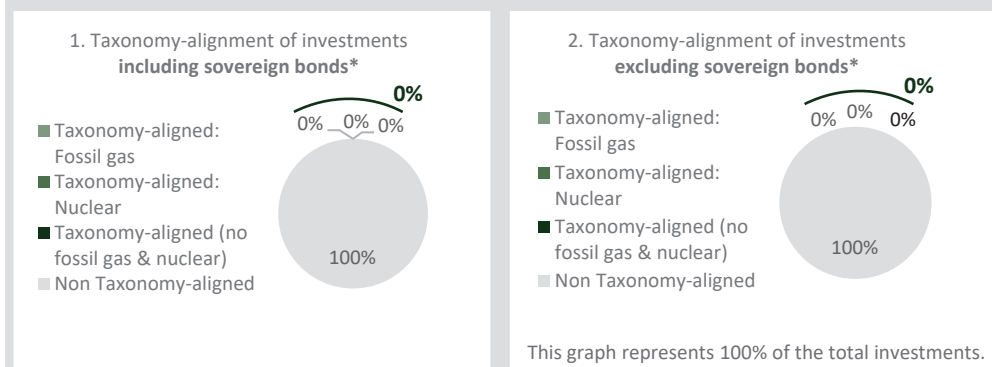
No

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

### ● What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



### What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



### What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes external funds, ETF, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?**

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***  
Not Applicable
- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***  
Not Applicable
- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***  
Not Applicable
- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***  
Not Applicable



**Where can I find more product specific information online?**

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

**Product name:**

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

**Legal entity identifier:**

549300SIHSO687LWLI13

## Environmental and/or social characteristics

**Sustainable investment** means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: \_\_\_%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: \_\_\_%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of \_\_\_% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



### What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio will be



## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

composed of issuers that are leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG best-practice.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

### ● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

**Sustainability indicators** measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

— ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

— ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

*The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.*

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

No

**Principal adverse impacts** are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



### What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy.. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualifies as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company (i.e., applicable only to direct investments).

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

**The investment strategy** guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

Company Exclusions based on International Standards and Policies	Exclusion Criteria
Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles	No
Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL)	No
Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist	No
Company Exclusions based on Revenue Thresholds	
Adult Entertainment Production	>5%
Controversial Weapons direct ownership	No
Controversial Weapons indirect ownership Involvement	>10%
Military Contracting Weapons	>0%
Military Contracting Weapons related products and /or services	>5%
Small Arms	>0%
Fur and specialty leather production	>5%
Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods)	Combined Revenues >5%
Thermal Coal Extraction	>5%
Thermal Coal Power Generation	>10%
Cannabis (recreational purposes)	>5%
Gambling	>5%
Genetically Modified Organisms	>5%
Tobacco Producing Companies	>0%
Tobacco Products Related Products/Services	>5%
Tobacco Products Retail and/or Distribution	>50%
Government Exclusions based on Norms and Policies	
Countries listed on ABN AMRO Sanctions List	No
Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT)	Yes
Ratification Paris Agreement	Yes
Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour	Yes

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

- **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

**Good governance** practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

SFDR Component	Indicator	Exclusion Criteria	Description
Sound Management Structure	UN Global Compact - Principle 10	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery.
	Governance controversy assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition.
Employee Relations	UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6	Watchlist and Non-Compliant status	Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation.
	Social Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment.
Tax Compliance	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration.
Remuneration of Staff	Governance Controversy Assessment	High & Severe Levels	As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration.

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



**Asset allocation** describes the share of investments in specific assets.

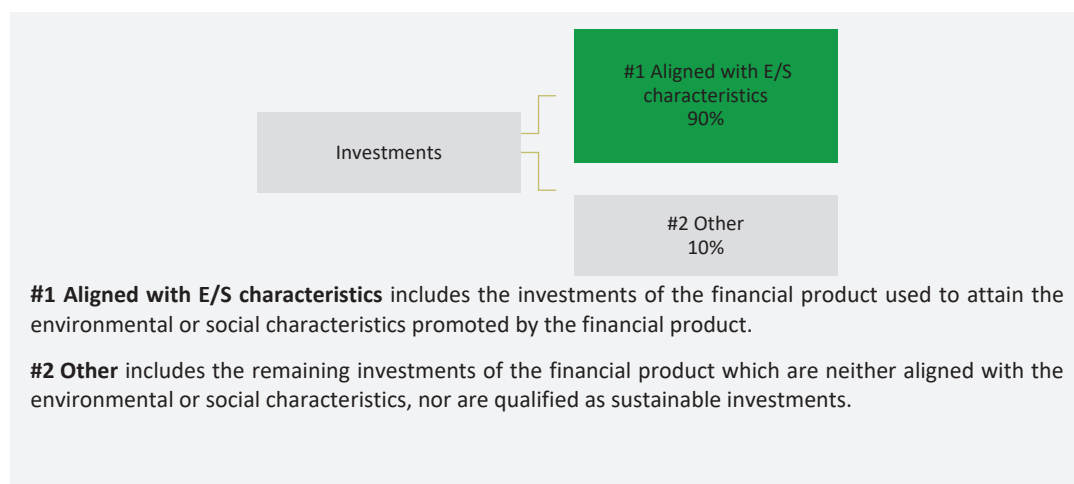
### What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



### To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

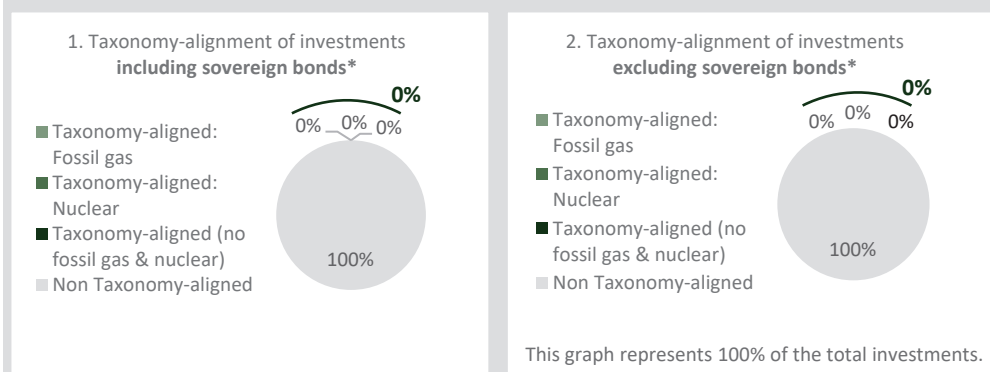
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy<sup>1</sup>?**

- Yes:
- In fossil gas     In nuclear energy
- No

*The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds\*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



\* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



**What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable



**What is the minimum share of socially sustainable investments?**

Not Applicable

<sup>1</sup> Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

## ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



### What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



### Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable

**Reference benchmarks** are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.



### Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:  
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>



