

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

Productbenaming: Altaica Sustainable Equity Opportunity Fund
Identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI): 254900FMAVC8BRSDIH15

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

Heeft dit financieel product een duurzamebeleggingsdoelstelling?



Ja



Nee



Dit product zal minimaal de volgende **duurzame beleggingen met een ecologische doelstelling** doen: __ %



in economische activiteiten die volgens de EU-taxonomie als ecologisch duurzaam gelden



in economische activiteiten die volgens de EU-taxonomie niet als ecologisch duurzaam gelden



Dit product zal minimaal de volgende **duurzame beleggingen met een sociale doelstelling** doen: %



Dit product **promoot ecologische/sociale (E/S) kenmerken**. Hoewel duurzaam beleggen niet het doel ervan is, zal het een minimum van 80% duurzame beleggingen hebben



met een ecologische doelstelling in economische activiteiten die volgens de EU-taxonomie als ecologisch duurzaam gelden



met een ecologische doelstelling in economische activiteiten die volgens de EU-taxonomie niet als ecologisch duurzaam gelden



met een sociale doelstelling



Dit product promoot E/S-kenmerken, maar **zal niet duurzaam beleggen**.

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

De **EU-taxonomie** is een classificatiesysteem dat is vastgelegd in Verordening (EU) 2020/852. Het gaat om een lijst van **ecologisch duurzame economische activiteiten**. Die verordening bevat geen lijst van sociaal duurzame economische activiteiten. Duurzame beleggingen met een ecologische doelstelling kunnen wel of niet op de taxonomie zijn afgestemd.

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

Het product promoot kenmerken op het gebied van lage Co2-uitstoot, sociale aspecten en goed bestuur.

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

Minimaal 80% van de portefeuille heeft bij aanschaf op elk van de drie ESG-pijlers (E, S en G) een score van ten minste 5 op een schaal van 1–10, op basis van een score van een onafhankelijke, wereldwijd toonaangevende dataprovider.

In aanvulling op deze minimale ESG scores, bepaalt het financiële product CO2-/carbonrisicomaatstaven op portefeuilleniveau. Deze zijn asset-gewogen en gebaseerd op extern bedrijfsniveau-onderzoek door een onafhankelijke, wereldwijd toonaangevende

dataproducer. Het fonds hanteert een maximale 'carbon risk score' van 10/100 en een maximum percentage investeringen betrokken bij fossiele brandstoffen van 7/100. De portefeuille wordt maandelijks herberekend op de genoemde pijlers.

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

Ecologisch: bijdragen aan een economie met lage koolstofuitstoot door investeringen in ondernemingen met laag carbonrisico en zonder materiële betrokkenheid bij fossiele brandstoffen.

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

De duurzame beleggingen worden voor het 'DNSH' (Do Not Significant Harm) getoetst aan relevante PAI-indicatoren. Hiervoor worden minimumdrempels gebruikt, waaronder:

- Klimaat: historische Carbon Risk Score <10/100 op portefeuilleniveau; uitsluiting van ondernemingen met materiële betrokkenheid bij fossiele brandstoffen (<7/100 op portefeuilleniveau).
- Schendingen van internationale normen: uitsluiting van emittenten met bevestigde ernstige schendingen van de UN Global Compact/OESO-richtsnoeren.
- Overige relevante PAI's: waar data beschikbaar is, worden drempels en uitsluitingen toegepast voor indicatoren inzake broeikasgasemissies, betrokkenheid bij controversiële wapens, en milieu-overtredingen; bij overschrijding volgt uitsluiting of engagement met escalatie.

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

Voor het deel duurzame beleggingen worden PAI-indicatoren benut als DNSH-toets (zie boven).

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

Duurzame beleggingen worden gescreend op verenigbaarheid met de OESO-richtsnoeren en leidende beginselen van de VN inzake bedrijfsleven en mensenrechten. Bij schending worden deze beleggingen uitgesloten (zie boven).

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

Andere duurzame beleggingen mogen evenmin ernstig afbreuk doen aan ecologische of sociale doelstellingen.

Wordt in dit financiële product rekening gehouden met de belangrijkste ongunstige effecten op duurzaamheidsfactoren?

- ☒ Ja, belegt minimaal 80% in duurzame beleggingen (artikel 2(17) SFDR). Conform de SFDR-uitvoeringsverordening worden de belangrijkste ongunstige effecten (PAI-indicatoren) systematisch meegenomen in het beleggingsproces en gebruikt voor de 'do no significant harm'-toets (DNSH) op het deel duurzame beleggingen.

☐ Nee

Welke beleggingsstrategie hanteert dit financiële product?

De beleggingsstrategie stuurt beleggingsbeslissingen op basis van factoren als beleggingsdoelstellingen en risicotolerantie.



Het product zal longpositities nemen in aandelen die voldoende scoren op de ESG waarden, conform bovenstaande toelichting. Er wordt daartoe gebruik gemaakt van algoritmes om geschikte beleggingen te selecteren. Het uiteindelijke selecteren van beleggingen en uitvoeren van transacties gebeurt discretionair.

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

Minimaal 80% duurzame beleggingen (artikel 2(17) SFDR). Deze beleggingen:

- Leveren een bijdrage aan een ecologische doelstelling: transitie naar een economie met lage koolstofuitstoot, door te beleggen in ondernemingen met laag carbonrisico en zonder materiële betrokkenheid bij fossiele brandstoffen; en
- Doorstaan de DNSH-toets aan relevante PAI-indicatoren (zie boven).

Ondernemingen in de zin van artikel 12, lid 1, punten a) tot en met g) van de Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1818 zijn uitgesloten van investeringen door het product.

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

Er is geen minimumpercentage voor het beperken van de beleggingsruimte toegezegd.

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

Het fonds beoordeelt alvorens beleggingen te doen de uitgevende instellingen op het gebied van managementstructuren, werknemersrelaties, beloningsbeleid en belastingnaleving en belegt alleen in de betreffende aandelen mits aan de eisen van goed bestuur is voldaan.

Praktijken op het gebied van goed bestuur omvatten goede managementstructuren, betrekkingen met werknemers, personeelsbeloning en naleving van de belastingwetgeving.



Op de taxonomie afgestemde activiteiten worden uitgedrukt als aandeel van:

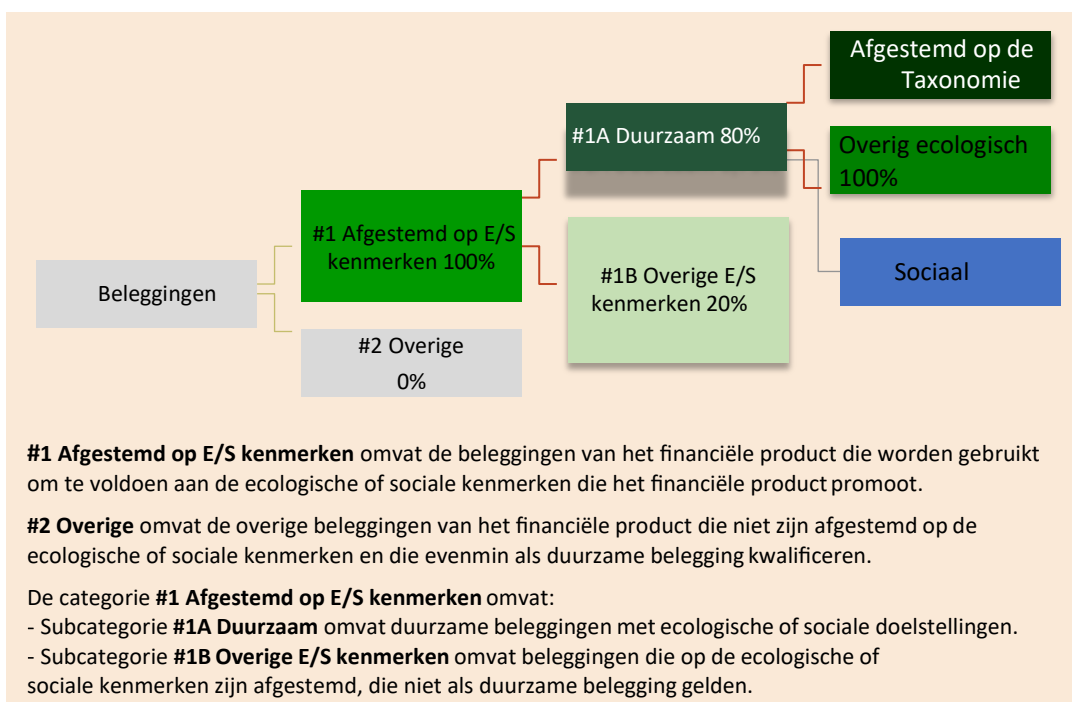
- de **omzet** die het aandeel weergeeft van de opbrengsten uit

groene activiteiten van ondernemingen waarin is belegd;

- de **kapitaaluitgaven** (CapEx) die laten zien welke groene beleggingen worden gedaan door de ondernemingen waarin is belegd, bv. voor een transitie naar een groene economie.



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



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

Het fonds maakt uitsluitend gebruik van derivaten om de portefeuille geheel of gedeeltelijk af te dekken tegen marktrisico's. Derivaten worden niet gebruikt om gepromote E/S kenmerken te verwezenlijken.

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

Het minimumaandeel bedraagt 0%.

Belegt het financiële product in activiteiten in de sectoren fossiel gas en/of kernenergie die aan de EU-taxonomie voldoen¹?

☐ Ja

☒ Nee

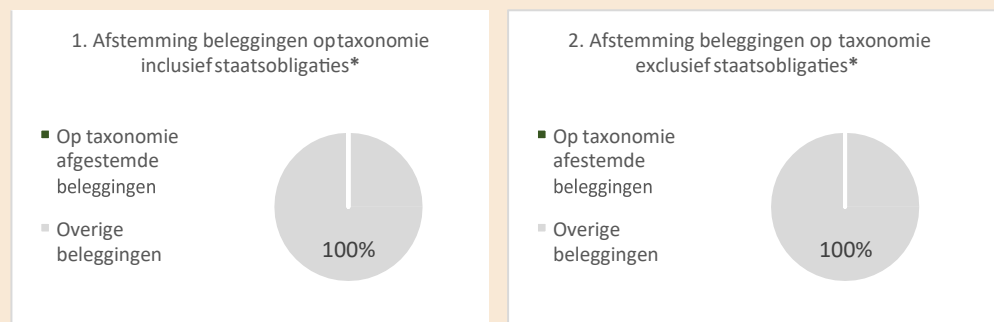
Om te bepalen of aan de EU-taxonomie wordt voldaan, bevatten de criteria voor **fossiel gas** emissie-grenswaarden en de omschakeling op hernieuwbare energie of koolstofarme brandstoffen tegen eind 2035. Voor **kern-energie** bevatten de criteria uitgebreide regels inzake veiligheid en afvalbeheer.

Faciliterende activiteiten maken het rechtstreeks mogelijk dat andere activiteiten een substantiële bijdrage leveren aan een ecologische doelstelling. **Transitieactiviteiten** zijn activiteiten waarvoor nog geen koolstofarme alternatieven beschikbaar zijn en die onder meer broeikasgasemissieniveaus hebben die overeenkomen met de beste prestaties.



zijn duurzame beleggingen met een ecologische doelstelling die **geen rekening houden met de criteria** voor ecologisch duurzame economische activiteiten in het kader van

De twee onderstaande diagrammen tonen in groen het minimumpercentage beleggingen op de EU-taxonomie afgestemde beleggingen. (Het percentage bedraagt 0%, en derhalve is er geen groen deel zichtbaar in de grafiek) Er is geen geschikte methode om te bepalen in hoeverre staatsobligaties* op de taxonomie zijn afgestemd. Daarom geeft het eerste diagram de mate van afstemming voor alle beleggingen van het financiële product inclusief staatsobligaties, terwijl het tweede diagram alleen voor de beleggingen van het financiële product in andere producten dan staatsobligaties aangeeft in hoeverre die op de taxonomie zijn afgestemd



***Voor deze diagrammen omvatten "staatsobligaties" alle blootstellingen aan overheden.**

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

Het minimumaandeel bedraagt 0%.



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

Het minimumaandeel bedraagt 80%.



● **Wat is het minimumaandeel van sociaal duurzame beleggingen?**

Het minimumaandeel bedraagt 0%.



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

Niet van toepassing.



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

Niet van toepassing. Omdat er geen traditionele benchmark is aangewezen, wordt naleving gemeten aan de hand van interne due diligence, monitoring en rapportage.

Referentie-benchmarks zijn indices waarmee wordt gemeten of het financiële product ecologische of sociale kenmerken verwezenlijkt die dat product promoot.



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

Meer specifieke informatie over dit product vindt u op deze website:

<https://www.altaica.com>

Daar vindt u tevens de precontractuele duurzaamheidsinformatie, het prospectus, en overige relevante informatie.