

### **Hinweis**

Dieses Dokument ist ein Auszug aus der deutschen Übersetzung des Jahresberichts und sollte in Verbindung mit diesem gelesen werden. Sollten die Sprachversionen des Jahresberichts und dieses Dokuments an irgendeiner Stelle voneinander abweichen, ist die englische Version des Jahresberichts maßgeblich.

Das Basisinformationsblatt, der Verkaufsprospekt und der letzte Jahres- bzw. Halbjahresbericht des Investmentfonds sind die allein verbindliche Grundlage für den Erwerb von Fondsanteilen.

Stand 10. März 2024

## Vorlage für regelmäßige Offenlegungen zu den in Artikel 8, Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und in Artikel 6, Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte.

### Nachhaltige Anlagen

sind Anlagen in eine Wirtschaftsaktivität, die zu einem ökologischen oder sozialen Ziel beiträgt, unter der Voraussetzung, dass die Anlage ökologische oder soziale Ziele nicht erheblich beeinträchtigt und dass sich die Investitionsempfänger an bewährte Verfahren der Unternehmensführung halten.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/ 852 festgelegtes Klassifizierungssystem mit einer Liste **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftsaktivitäten**. Diese Verordnung legt keine Liste mit sozial nachhaltigen Wirtschaftsaktivitäten fest. Nachhaltige Anlagen mit ökologischem Ziel können im Einklang mit der Taxonomie stehen oder nicht.

### Name des Produkts:

Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Balanced

### Rechtsträgerkennung:

549300R4FDYZZ8HUD175

## Ökologische und/oder soziale Aspekte

### Hatte dieses Finanzprodukt ein nachhaltiges Anlageziel?



Ja



Nein

☐ Es wurden **nachhaltige Anlagen mit ökologischem Ziel** getätigt: \_\_\_\_%



in Wirtschaftsaktivitäten, die als ökologisch nachhaltig im Sinne der EU-Taxonomie gelten



in Wirtschaftsaktivitäten, die nicht als ökologisch nachhaltig im Sinne der EU-Taxonomie gelten



mit einem sozialen Ziel



Es wurden **ökologische/soziale (E/S) Aspekte gefördert** und es gab einen Anteil nachhaltiger Anlagen in Höhe von \_\_\_\_ %, auch wenn nachhaltige Anlagen kein Anlageziel waren



mit einem ökologischen Ziel in Wirtschaftsaktivitäten, die als ökologisch nachhaltig im Sinne der EU-Taxonomie gelten



mit einem ökologischen Ziel in Wirtschaftsaktivitäten, die nicht als ökologisch nachhaltig im Sinne der EU-Taxonomie gelten



Es wurden **nachhaltige Anlagen mit sozialem Ziel** getätigt: \_\_\_\_%



Es wurden E/S-Aspekte gefördert, aber **keine nachhaltigen Anlagen getätigt**



### Inwieweit wurden die von diesem Finanzprodukt geförderten ökologischen und/oder sozialen Aspekte erfüllt?

Der Teilfonds förderte ökologische und soziale Aspekte durch seine Anlagen in Fonds mit der französischen ISR-Kennzeichnung oder Fonds mit einer gleichwertigen europäischen Kennzeichnung. Im Referenzzeitraum waren 92.44 % des Teilfonds (außer Barmittel) in Fonds mit ISR-Kennzeichnung investiert oder in Fonds mit einer gleichwertigen europäischen Kennzeichnung. Der Indikator ist ein durchschnittlicher Monatswert über den gesamten Zeitraum.

Die französische ISR-Kennzeichnung (Investissement Socialement Responsable) ist eine externe Auszeichnung zur Identifizierung verantwortungsvoller Anlagefonds. Ziel dieser vom französischen Finanzministerium geschaffenen und unterstützten Kennzeichnung ist die bessere Sichtbarkeit von ESG-Produkten unter französischen und europäischen Anlegern.

Die Kennzeichnung hat unterschiedliche Kriterien, darunter die Überwachung konkreter außerfinanzieller Leistungskennzahlen in den Bereichen Umwelt, Soziales, Menschenrechte und Unternehmensführung. Die Fonds müssen auch nachweisen, dass sie ein bedeutend besseres ESG-Profil haben als der ESG-Referenzindex im Einklang mit ihrer Anlagestrategie. Diese bedeutende Verbesserung kann erreicht werden durch den Ausschluss von 20 % des anfänglichen ESG-Referenzindex oder durch eine bedeutend bessere durchschnittliche ESG-Einstufung.

Nach einer ersten Prüfung durch eine externe Organisation kann der Fonds die Kennzeichnung drei Jahre behalten (mit jährlichen Kontrollen).



#### Wie schnitten die Nachhaltigkeitsindikatoren ab?

Der Teilfonds nutzte den Prozentanteil der Anlagen in Fonds mit ISR-Kennzeichnung als Nachhaltigkeitsindikator. Im Einklang mit der vorvertraglichen Verpflichtung des Teilfonds lag dieser Indikator bei über 90 % (außer Barmittel).



#### ...und im Vergleich zu früheren Zeiträumen?

Ab dem kommenden Berichtszeitraum wird ein Vergleich des Abschneidens des Teilfonds bei den Nachhaltigkeitsindikatoren mit früheren Zeiträumen verfügbar sein.



#### Was waren die Ziele der nachhaltigen Anlagen, die das Finanzprodukt teilweise tätigte und welchen Beitrag leisteten die nachhaltigen Anlagen zu diesen Zielen?

Entfällt

**Nachhaltigkeitsindikatoren** messen den Grad der Erreichung der vom Finanzprodukt geförderten ökologischen oder sozialen Aspekte.

**Wesentliche negative Auswirkungen** sind die wichtigsten negativen Auswirkungen einer Anlageentscheidung auf Nachhaltigkeitsfaktoren im Zusammenhang mit ökologischen, sozialen und arbeitnehmerbezogenen Aspekten, der Einhaltung der Menschenrechte und der Bekämpfung von Korruption und Geldwäsche.

Inwiefern führten die nachhaltigen Anlagen, die das Finanzprodukt teilweise tätigte, nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung ökologisch oder sozial nachhaltiger Anlageziele?

Entfällt

Wie wurden die Indikatoren für negative Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Entfällt

Standen die nachhaltigen Anlagen im Einklang mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte? Einzelheiten:

Entfällt

Dem Grundsatz „keine erhebliche Beeinträchtigung“ der EU-Taxonomie zufolge dürfen Anlagen im Einklang mit der Taxonomie nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der Ziele der EU-Taxonomie führen. Dies ist verbunden mit spezifischen Kriterien der Europäischen Union.

Das DNSH-Prinzip gilt nur für dem Finanzprodukt zugrunde liegende Anlagen, bei denen die Kriterien der EU für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigt werden. Bei den dem restlichen Anteil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Anlagen werden die Kriterien der EU für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten nicht berücksichtigt.

Andere nachhaltige Anlagen dürfen ebenfalls nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung ökologischer oder sozialer Ziele führen.



Inwiefern berücksichtigte dieses Finanzprodukt wesentliche negative Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren?

Die negativen Auswirkungen des Teilfonds wurden berücksichtigt durch eine Begrenzung der allgemeinen Exposition gegenüber Fonds, welche die wesentlichen negativen Auswirkungen nicht im Rahmen ihrer Anlagestrategie mit Kennzeichnung berücksichtigen (ISR-Kennzeichnung oder gleichwertige ESG-Kennzeichnung).

Weitere Informationen finden Sie in der „Erklärung zu wesentlichen negativen Auswirkungen von Anlageentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren“ und in der Richtlinie von Swiss Life Asset Managers Luxembourg zu verantwortungsvollen Anlagen auf der Webseite von Swiss Life Asset Managers Luxembourg mit einer Bestimmung des implementierten Verfahrens zur Berücksichtigung von wesentlichen negativen Auswirkungen (<https://lu.swisslife-am.com/en/home/responsible-investment/sustainability-related-disclosures.html>).



Welches waren die wichtigsten Anlagen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die 15 größten Portfoliopositionen während des Zeitraums. Die Liste basiert auf den durchschnittlichen Portfoliopositionen am Ende jedes Monats des Geschäftsjahres. Die rechte Spalte zeigt den Prozentanteil der einzelnen Positionen im Durchschnitt und zum Monatsende.

Die Liste umfasst die Anlagen des Finanzprodukts mit dem **größten Anteil** in folgendem Referenzzeitraum:

| Größte Anlagen                                              | Sektor | % Vermögenswerte | Land                       |
|-------------------------------------------------------------|--------|------------------|----------------------------|
| Swiss Life Fund (F) Money Market                            | Funds  | 17.28%           | EU Eurozone DEMA insgesamt |
| Swiss Life Funds (Lux) Equity ESG Global Protect            | Funds  | 10.93%           | Weltweit insgesamt         |
| Swiss Life Funds (Lux) Equity USA                           | Funds  | 9.36%            | USA                        |
| Swiss Life Funds (F) Bond 6M                                | Funds  | 6.77%            | Europa insgesamt           |
| Lyxor MSCI Europe ESG Leaders DR UCITS ETF                  | Funds  | 6.33%            | Europa insgesamt           |
| Swiss Life Funds (Lux) Equity Global                        | Funds  | 5.63%            | Weltweit insgesamt         |
| Swiss Life Funds (Lux) Equity Global High Dividend          | Funds  | 5.37%            | Weltweit insgesamt         |
| Swiss Life Funds (Lux) Equity ESG Euro Zone                 | Funds  | 5.02%            | Europa insgesamt           |
| Swiss Life Funds (Lux) Equity ESG Global Minimum Volatility | Funds  | 4.82%            | Weltweit insgesamt         |
| Swiss Life Funds (LUX) Income Equity ESG Euro Zone          | Funds  | 4.38%            | Europa insgesamt           |
| Swiss Life Funds (F) Equity Euro Zone Minimum Volatility    | Funds  | 3.85%            | Europa insgesamt           |
| Swiss Life Funds (Lux) Bond ESG Global Corporates           | Funds  | 3.56%            | Weltweit insgesamt         |
| Swiss Life Funds (Lux) Bond Global High Yield               | Funds  | 2.90%            | Weltweit insgesamt         |
| Swiss Life Funds (F) Equity Europe Minimum Volatility       | Funds  | 2.33%            | Europa insgesamt           |
| Pareto SICAV - Pareto Nordic Corporate Bond                 | Funds  | 1.47%            | Europa insgesamt           |

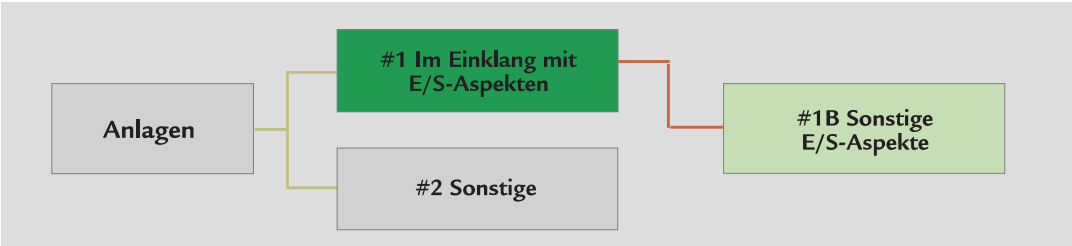


Die **Portfoliostrukturierung** beschreibt den Anteil von Anlagen in spezifische Vermögenswerte.

Wie hoch war der Anteil nachhaltigkeitsbezogener Anlagen?

85.64 % des Teilfonds stand im Einklang mit den E/S-Aspekten (#1). Die Kategorie „Sonstiges“ (#2) umfasste Anlagen in nicht gekennzeichnete Fonds, im Portfolio zu Absicherungszwecken genutzte Derivate und Barmittel bzw. Barmitteläquivalente zur Sicherstellung der Liquidität des Teilfonds. Diese Anlagen wurden nicht nach ESG-Kriterien bemessen, auch nicht nach ökologischen oder sozialen Mindestgarantien gemäß der Definition der SFDR.

Wie war das Portfolio strukturiert?



**#1 Im Einklang mit E/S-Aspekten** umfasst die Anlagen des Finanzprodukts, die genutzt werden, um die ökologischen oder sozialen Aspekte zu erreichen, die das Finanzprodukt fördert.

**#2 Sonstiges** umfasst die restlichen Anlagen des Finanzprodukts. Sie stehen nicht im Einklang mit den ökologischen oder sozialen Aspekten und gelten auch nicht als nachhaltige Anlagen.

 In welchen Wirtschaftssektoren wurden Anlagen getätigt?

| Sektor                                                     | Untersektor                                                                                               | %<br>Vermögenswerte | Gewichtung des<br>Untersektors |
|------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|--------------------------------|
| K - FINANZ- UND<br>VERSICHERUNGSTÄTIGKEITEN                |                                                                                                           | 27.09%              |                                |
|                                                            | 64 - Finanzdienstleistungen, außer Versicherungen und Pensionsfonds                                       |                     | 22.55%                         |
|                                                            | 66 - Mit Finanzdienstleistungen und Versicherungstätigkeiten verbundene Aktivitäten                       |                     | 2.12%                          |
|                                                            | 65 - Versicherung, Rückversicherung und Pensionsfonds, außer obligatorische Sozialversicherung            |                     | 2.42%                          |
| D - VERSORGUNG MIT STROM, GAS,<br>DAMPF UND KLIMATISIERUNG |                                                                                                           | 3.27%               |                                |
|                                                            | 35 - Versorgung mit Strom, Gas, Dampf und Klimatisierung                                                  |                     | 3.27%                          |
| L - IMMOBILIENAKTIVITÄTEN                                  |                                                                                                           | 1.21%               |                                |
|                                                            | 68 - IMMOBILIENAKTIVITÄTEN                                                                                |                     | 1.21%                          |
| C - FERTIGUNG                                              |                                                                                                           | 21.89%              |                                |
|                                                            | 28 - Fertigung nicht näher bestimmter Maschinen und Anlagen                                               |                     | 2.00%                          |
|                                                            | 27 - Fertigung von Elektrogeräten                                                                         |                     | 1.16%                          |
|                                                            | 20 - Fertigung von Chemikalien und chemischen Produkten                                                   |                     | 2.12%                          |
|                                                            | 11 - Fertigung von Getränken                                                                              |                     | 1.43%                          |
|                                                            | 21 - Fertigung von Basisarzneimitteln und pharmazeutischen Präparaten                                     |                     | 3.89%                          |
|                                                            | 29 - Fertigung von Motorfahrzeugen, Anhängern und Sattelanhängern                                         |                     | 0.79%                          |
|                                                            | 22 - Fertigung von Gummi- und Kunststoffprodukten                                                         |                     | 0.51%                          |
|                                                            | 30 - Fertigung sonstiger Transportgeräte                                                                  |                     | 0.63%                          |
|                                                            | 26 - Fertigung von Computer-, Elektronik- und Optikprodukten                                              |                     | 4.20%                          |
|                                                            | 10 - Fertigung von Nahrungsmitteln                                                                        |                     | 1.34%                          |
|                                                            | 23 - Fertigung anderer nicht-metallischer Mineralprodukte                                                 |                     | 0.43%                          |
|                                                            | 17 - Fertigung von Papier und Papierprodukten                                                             |                     | 0.65%                          |
|                                                            | 14 - Fertigung von Bekleidung                                                                             |                     | 0.66%                          |
|                                                            | 19 - Fertigung von Koks und raffinierten Erdölprodukten                                                   |                     | 0.80%                          |
|                                                            | 15 - Fertigung von Lederprodukten und ähnlichen Produkten                                                 |                     | 0.35%                          |
|                                                            | 32 - Sonstige Fertigung                                                                                   |                     | 0.30%                          |
|                                                            | 25 - Fertigung verarbeiteter Metallprodukte außer Maschinen und Anlagen                                   |                     | 0.10%                          |
|                                                            | 16 - Fertigung von Holz und Holz- und Korkprodukten, außer Möbel; Fertigung von Stroh- und Flechtartikeln |                     | 0.05%                          |
|                                                            | 12 - Fertigung von Tabakprodukten                                                                         |                     | 0.18%                          |
|                                                            | 24 - Fertigung von Basismetallen                                                                          |                     | 0.27%                          |
|                                                            | 18 - Druck und Reproduktion aufgezeichneter Medien                                                        |                     | 0.01%                          |
|                                                            | 13 - Fertigung von Textilwaren                                                                            |                     | 0.01%                          |

| Sektor                                                                                          | Untersektor                                                                                                  | %<br>Vermögenswerte | Gewichtung des<br>Untersektors |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|--------------------------------|
| F - BAUWESEN                                                                                    | 33 - Reparatur und Installation von Maschinen und Anlagen                                                    | 0.97%               | 0.00%                          |
|                                                                                                 | 31 - Fertigung von Möbeln                                                                                    |                     | 0.00%                          |
|                                                                                                 | 42 - Bauingenieurwesen                                                                                       |                     | 0.67%                          |
|                                                                                                 | 43 - Spezialisierte Bautätigkeiten                                                                           |                     | 0.04%                          |
| N - ADMINISTRATIVE UND<br>UNTERSTÜTZENDE DIENSTLEISTUNGEN                                       | 41 - Errichtung von Gebäuden                                                                                 | 1.19%               | 0.26%                          |
|                                                                                                 | 77 - Miet- und Leasingaktivitäten                                                                            |                     | 0.82%                          |
|                                                                                                 | 79 - Reisevermittlung, Reiseveranstalter, Buchungsdienst und ähnliche Aktivitäten                            |                     | 0.09%                          |
|                                                                                                 | 82 - Büroverwaltung, Bürounterstützung und andere unterstützende Unternehmensdienstleistungen                |                     | 0.17%                          |
|                                                                                                 | 78 - Beschäftigungsaktivitäten                                                                               |                     | 0.02%                          |
|                                                                                                 | 80 - Aktivitäten im Bereich Sicherheit und Ermittlung                                                        |                     | 0.06%                          |
|                                                                                                 | 81 - Dienstleistungen für Aktivitäten im Bereich Gebäude und Landschaftsbau                                  |                     | 0.02%                          |
|                                                                                                 |                                                                                                              |                     |                                |
| J - INFORMATION UND KOMMUNIKATION                                                               |                                                                                                              | 7.20%               |                                |
|                                                                                                 | 58 - Verlagstätigkeiten                                                                                      |                     | 2.47%                          |
|                                                                                                 | 61 - Telekommunikation                                                                                       |                     | 1.83%                          |
|                                                                                                 | 62 - Computerprogrammierung, Beratung und ähnliche Aktivitäten                                               |                     | 1.37%                          |
|                                                                                                 | 63 - Aktivitäten im Bereich Informationsdienste                                                              |                     | 1.26%                          |
|                                                                                                 | 59 - Produktion von Filmen, Videos und Fernsehsendungen, Tonaufnahmen und Aktivitäten im Bereich Musikverlag |                     | 0.17%                          |
| H - TRANSPORT UND LAGERUNG                                                                      | 60 - Programmgestaltungs- und Rundfunkaktivitäten                                                            | 1.51%               | 0.09%                          |
|                                                                                                 |                                                                                                              |                     |                                |
|                                                                                                 | 49 - Landtransport und Transport über Rohrleitungen                                                          |                     | 0.67%                          |
|                                                                                                 | 53 - Post- und Kurieraktivitäten                                                                             |                     | 0.19%                          |
|                                                                                                 | 52 - Lagerhallen und unterstützende Transportaktivitäten                                                     |                     | 0.33%                          |
|                                                                                                 | 51 - Luftverkehr                                                                                             |                     | 0.12%                          |
|                                                                                                 | 50 - Wassertransport                                                                                         |                     | 0.21%                          |
| I - BEHERBERGUNGSAKTIVITÄTEN UND<br>GASTRONOMISCHE TÄTIGKEITEN                                  |                                                                                                              | 0.17%               |                                |
|                                                                                                 | 55 - Beherbergung                                                                                            |                     | 0.04%                          |
|                                                                                                 | 56 - Gastronomische Tätigkeiten                                                                              |                     | 0.12%                          |
| G - GROSS- UND EINZELHANDEL;<br>REPARATUR VON MOTORFAHRZEUGEN<br>UND MOTORRÄDERN                |                                                                                                              | 4.26%               |                                |
|                                                                                                 | 47 - Einzelhandel, außer Motorfahrzeuge und Motorräder                                                       |                     | 3.41%                          |
|                                                                                                 | 46 - Großhandel, außer Motorfahrzeuge und Motorräder                                                         |                     | 0.76%                          |
|                                                                                                 | 45 - Groß- und Einzelhandel und Reparatur von Motorfahrzeugen und Motorrädern                                |                     | 0.09%                          |
| E - WASSERVERSORGUNG; AKTIVITÄTEN<br>IM BEREICH ABWASSER UND<br>ABFALLENTSORGUNG UND -SANIERUNG |                                                                                                              | 0.33%               |                                |
|                                                                                                 | 37 - Abwasser                                                                                                |                     | 0.19%                          |
|                                                                                                 | 36 - Wassersammlung, -aufbereitung und -versorgung                                                           |                     | 0.03%                          |

| Sektor                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | Untersektor                                                                                         | %<br>Vermögenswerte | Gewichtung des<br>Untersektors |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|--------------------------------|
| M - PROFESSIONELLE, WISSENSCHAFTLICHE UND TECHNISCHE AKTIVITÄTEN                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 38 - Aktivitäten im Bereich Müllabfuhr, Abfallverwertung und Müllbeseitigung; Materialrückgewinnung | 2.04%               | 0.12%                          |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 70 - Aktivitäten in Firmenzentralen; Aktivitäten im Bereich Unternehmensberatung                    |                     | 0.62%                          |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 73 - Werbung und Marktforschung                                                                     |                     | 0.36%                          |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 71 - Aktivitäten im Bereich Architektur und Ingenieurwesen; technische Prüfungen und Analysen       |                     | 0.27%                          |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 69 - Rechts- und Buchhaltungsaktivitäten                                                            |                     | 0.18%                          |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 72 - Wissenschaftliche Forschung und Entwicklung                                                    |                     | 0.54%                          |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 75 - Tiermedizinische Aktivitäten                                                                   |                     | 0.06%                          |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 74 - Sonstige professionelle, wissenschaftliche und technische Aktivitäten                          |                     | 0.00%                          |
| B - BERGBAU UND ABBAU                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                                                                                                     | 1.13%               |                                |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 6 - Förderung von Rohöl und Erdgas                                                                  |                     | 0.76%                          |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 9 - Aktivitäten im Bereich Unterstützungsdienste für Bergbau                                        |                     | 0.13%                          |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 7 - Abbau von Metallerzen                                                                           |                     | 0.21%                          |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 8 - Sonstiger Bergbau und Abbau                                                                     |                     | 0.02%                          |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 5 - Abbau von Kohle und Braunkohle                                                                  |                     | 0.01%                          |
| Q - AKTIVITÄTEN IM BEREICH MENSCHLICHE GESUNDHEIT UND SOZIALARBEIT                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                     | 0.35%               |                                |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 86 - Aktivitäten im Bereich menschliche Gesundheit                                                  |                     | 0.34%                          |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 87 - Aktivitäten im Bereich Pflegeheime                                                             |                     | 0.00%                          |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 88 - Aktivitäten im Bereich Sozialarbeit ohne Unterbringung                                         |                     | 0.00%                          |
| R - KUNST, UNTERHALTUNG UND FREIZEIT                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                     | 0.06%               |                                |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 93 - Sport-, Unterhaltungs- und Freizeitaktivitäten                                                 |                     | 0.03%                          |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 92 - Spiel- und Wettaktivitäten                                                                     |                     | 0.03%                          |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 90 - Kreative und künstlerische Tätigkeiten und Unterhaltungsaktivitäten                            |                     | 0.03%                          |
| S - SONSTIGE DIENSTLEISTUNGSAKTIVITÄTEN                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                                                                                     | 0.01%               |                                |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 96 - Sonstige persönliche Dienstleistungsaktivitäten                                                |                     | 0.01%                          |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 95 - Reparatur von Computern, persönlichen Gegenständen und Haushaltsartikeln                       |                     | 0.00%                          |
| P - BILDUNG                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                     | 0.01%               |                                |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 85 - Bildung                                                                                        |                     | 0.01%                          |
| A - LANDWIRTSCHAFT, FORSTWIRTSCHAFT UND FISCHEREI                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                     | 0.01%               |                                |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 1 - Aktivitäten im Bereich Pflanzenbau, Viehwirtschaft, Jagd und zugehörige Dienstleistungen        |                     | 0.00%                          |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 3 - Fischerei und Fischzucht                                                                        |                     | 0.01%                          |
| O - ÖFFENTLICHE VERWALTUNG UND VERTEIDIGUNG; OBLIGATORISCHE SOZIALVERSICHERUNG                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                                                                                     | 0.21%               |                                |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 84 - Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung                     |                     | 0.21%                          |
| Sonstiges                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                                     | 27.10%              |                                |
| Die nachstehende Tabelle zeigt zudem den Anteil der Anlagen in Unternehmen, die in direktem Zusammenhang mit fossilen Rohstoffen stehen (nicht-metallurgische Kohle, Öl, Gas) - entweder, weil sie fossile Vorräte besitzen oder weil sie Einkünfte aus diesen Rohstoffen erzielen. Das Ausmaß der Exposition der einzelnen Unternehmen gegenüber fossilen Rohstoffen (Vorräte oder Einnahmen) wird nicht berücksichtigt; es kann begrenzt sein. Die Liste basiert auf den durchschnittlichen Portfoliopositionen am Ende jedes Quartals des Geschäftsjahres. |                                                                                                     |                     |                                |
| Portfolioanteil, der direkt in Unternehmen investiert ist, die in Zusammenhang mit fossilen Rohstoffen stehen                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                     | 7.17%               |                                |

Zur Einhaltung der EU-Taxonomie enthalten die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionsgrenzen und einen Wechsel zu vollständig erneuerbaren Energien oder Brennstoffe mit geringem CO<sub>2</sub>-Ausstoß bis Ende 2035. Die Kriterien für **Nuklearenergie** enthalten umfassende Vorschriften für Sicherheit und Abfallentsorgung.

**Ermöglichende Aktivitäten** ermöglichen es anderen Aktivitäten direkt, einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltziel zu leisten.

Bei **Übergangs Aktivitäten** stehen noch keine Alternativen mit geringen CO<sub>2</sub>-Emissionen zur Verfügung und sie haben unter anderem die bestmöglichen Treibhausgasemissionen.

Aktivitäten im Einklang mit der Taxonomie werden angegeben als Anteil:

- des **Umsatzes**, also als Anteil der Einnahmen aus grünen Aktivitäten der Investitionsempfänger.
- der **Investitionskosten** (CapEx), also als Anteil der grünen Investitionen der Investitionsempfänger, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- der **Betriebskosten** (OpEx) also als Anteil der grünen betrieblichen Aktivitäten der Investitionsempfänger.



## Inwieweit standen die nachhaltigen Anlagen mit ökologischem Ziel im Einklang mit der EU-Taxonomie?

Entfällt

☐ **Investierte das Finanzprodukt in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Nuklearenergie im Einklang mit der EU-Taxonomie<sup>1</sup>?**

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas

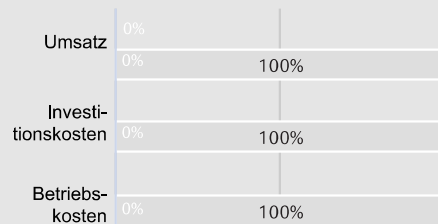
☐ In Nuklearenergie

☒ **Nein**

<sup>1</sup> Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Nuklearenergie stehen nur im Einklang mit der EU-Taxonomie, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels beitragen („Eindämmung des Klimawandels) und Ziele der EU-Taxonomie nicht in erheblichem Maße beeinträchtigen - siehe die Erklärung am linken Rand. Die Delegierte Verordnung (EU) 2022/1214 schreibt die vollständigen Kriterien für Wirtschaftsaktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Nuklearenergie fest, die im Einklang mit der EU-Taxonomie stehen.

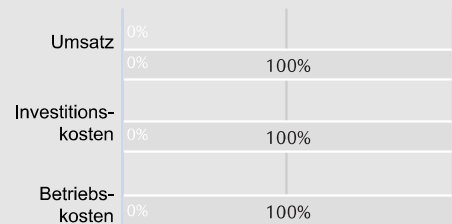
Die nachstehenden Grafiken zeigen in grün den Prozentanteil der Anlagen im Einklang mit der EU-Taxonomie. Es gibt keine geeignete Methode, um die Übereinstimmung von Staatsanleihen mit der Taxonomie zu bestimmen\*. Daher zeigt die erste Grafik die Übereinstimmung aller Anlagen des Finanzprodukts einschließlich Staatsanleihen mit der Taxonomie. Die zweite Grafik zeigt dagegen die Übereinstimmung der Anlagen des Finanzprodukts mit der Taxonomie, die keine Staatsanleihen sind.

1. Übereinstimmung der Anlagen mit der Taxonomie einschließlich Staatsanleihen\*



☐ Nicht im Einklang mit der Taxonomie  
☒ Im Einklang mit der Taxonomie: Fossiles Gas  
☒ Im Einklang mit der Taxonomie: Nuklearenergie  
☒ Im Einklang mit der Taxonomie (ohne Gas und Nuklearenergie)

2. Übereinstimmung der Anlagen mit der Taxonomie außer Staatsanleihen\*



☐ Nicht im Einklang mit der Taxonomie  
☒ Im Einklang mit der Taxonomie: Fossiles Gas  
☒ Im Einklang mit der Taxonomie: Nuklearenergie  
☒ Im Einklang mit der Taxonomie (ohne Gas und Nuklearenergie)

Diese Grafik enthält 100 % der gesamten Anlagen.

\* „Staatsanleihen“ umfassen für die Zwecke dieser Grafik alle staatlichen Engagements.

☐ **Wie hoch war der Anteil der Anlagen in Übergangsaktivitäten und ermöglichende Aktivitäten?**

Entfällt

☐ **Wie schnitt der Prozentanteil der Anlagen im Einklang mit der EU-Taxonomie im Vergleich zu früheren Berichtszeiträumen ab?**

Entfällt



sind nachhaltige Anlagen mit ökologischem Ziel, welche die Kriterien nicht erfüllen für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852.



## Welchen Anteil hatten nachhaltige Anlagen mit ökologischem Ziel, die nicht im Einklang mit der EU-Taxonomie stehen?

Entfällt



## Welchen Anteil hatten sozial nachhaltige Anlagen?

Entfällt



## Welche Anlagen sind unter „Sonstige“ enthalten, welchen Zweck verfolgten sie und gab es ökologische oder soziale Mindestgarantien?

Diese Anlagen umfassen Anlagen in nicht gekennzeichneten Fonds, in vom Teilfonds zu Absicherungszwecken genutzte Derivate und Barmittel bzw. Barmitteläquivalente zur Sicherstellung der Liquidität des Teilfonds. Diese Anlagen wurden nicht nach ESG-Kriterien bemessen, auch nicht nach ökologischen oder sozialen Mindestgarantien gemäß der Definition der SFDR.



### Welche Maßnahmen wurden ergriffen, um die ökologischen und/oder sozialen Aspekte während des Referenzzeitraums zu erfüllen?

Verschiedene Abteilungen implementierten interne Kontrollverfahren zur Sicherstellung der Einhaltung ökologischer und sozialer Aspekte: Portfolioverwaltung, Risikoabteilung, Innenrevision. Die letzten beiden Abteilungen sind unabhängig – sie unterstehen einem Vorgesetzten, der ein Verwaltungsratsmitglied von Swiss Life Group ohne operative Leitungsfunktion ist. Die Unabhängigkeit dieser Abteilungen gewährleistet die Objektivität der durchgeführten Prüfungen.

Die internen Kontrollverfahren zur Einhaltung der im vorvertraglichen Dokument beschriebenen verbindlichen Elemente umfasste folgende Prüfungen:

- Vorhandelsprüfungen basierend auf unseren internen Konformitäts- und Portfolioverwaltungssystemen
- Laufende Überwachung der verbindlichen Elemente im Rahmen der täglichen Prüfung der Anlagekonformität

### Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Vergleichsindex abgeschnitten?

Entfällt

- ☐ Inwiefern unterscheidet sich der Vergleichsindex von einem breiten Marktindex?

Entfällt

- ☐ Wie hat dieses Finanzprodukt abgeschnitten bei Nachhaltigkeitsindikatoren zur Bestimmung der Übereinstimmung des Vergleichsindex mit den geförderten ökologischen oder sozialen Merkmalen?

Entfällt

- ☐ Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Vergleichsindex abgeschnitten?

Entfällt

- ☐ Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Entfällt

Referenzindizes messen, ob ein Finanzprodukt die von ihm geförderten ökologischen oder sozialen Aspekte erfüllt.