

Anhang IV – Ergänzende Informationen (ungeprüft) Fortsetzung

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Systematic Global SmallCap Fund

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel können taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
Systematic Global SmallCap Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300HBMGWEEZN5BI34

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___ %

- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___ %

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 35,55 % an nachhaltigen Investitionen

- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.

Anhang IV – Ergänzende Informationen (ungeprüft) Fortsetzung

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

Systematic Global SmallCap Fund (Fortsetzung)



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

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

In der folgenden Tabelle sind die ökologischen und sozialen Merkmale aufgeführt, die vom Fonds während des Referenzzeitraums beworben wurden. Weitere Informationen zu diesen ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Prospekt des Fonds enthalten. Bitte beachten Sie den Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“, der Informationen darüber enthält, inwieweit der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt.

Vom Fonds beworbene ökologische und soziale Merkmale

Reduzierung der Kohlenstoffintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse aller Positionen des Fonds) im Vergleich zum MSCI ACWI Small Cap Index (der „Index“)

Investitionen in nachhaltige Anlagen

Ausschluss von Emittenten, die Tabakprodukte herstellen

Ausschluss von Emittenten, die Feuerwaffen und/oder Munition für Handfeuerwaffen herstellen, die für den Einzelhandelsverkauf an Zivilisten vorgesehen sind

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus dem Vertrieb (Großhandel oder Einzelhandel) von Schusswaffen und/oder Munition für Kleinwaffen für den zivilen Gebrauch erzielen

Ausschluss von Emittenten, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie gegen die UNGC-Grundsätze (die Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umweltschutz sowie Korruptionsbekämpfung umfassen) verstößen haben

Ausschluss von Emittenten, die Umsätze aus einer direkten Beteiligung an der Herstellung von Atomwaffen oder Atomwaffenkomponenten oder Trägerplattformen oder der Bereitstellung von Hilfsdienstleistungen in Verbindung mit Atomwaffen erzielen

Ausschluss von Emittenten, die an der Herstellung umstrittener Waffen beteiligt oder anderweitig in dieser Hinsicht engagiert sind (insbesondere Streumunition, biologische und chemische Waffen, Landminen, abgereichertes Uran, Blendlaser, nicht nachweisbare Fragmente und/oder Brandwaffen)

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus der Produktion und Förderung von Teersand (auch bekannt als Ölsand) erwirtschaften

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder der Stromerzeugung auf der Basis von Kraftwerkskohle erwirtschaften, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie den Green Bond Principles der International Capital Markets Association entsprechen

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus der Herstellung, dem Vertrieb, dem Einzelhandel und der Lieferung von Produkten im Zusammenhang mit Tabak erzielen

Umweltziele der EU-Taxonomie, zu denen der Fonds beiträgt

Klimaschutz

Anpassung an den Klimawandel

Anhang IV – Ergänzende Informationen (ungeprüft) Fortsetzung

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

Systematic Global SmallCap Fund (Fortsetzung)

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die Performance der Nachhaltigkeitsindikatoren, die zur Messung der Erreichung der einzelnen vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale verwendet werden, wie im Prospekt des Fonds näher beschrieben.

Nachhaltigkeitsindikator	Messgröße	2025	2024	2023
Investitionen in nachhaltige Anlagen	Vom Fonds gehaltene nachhaltige Investitionen, in %	35,55 %	29,08 %	24,21 %
Reduzierung der Kohlenstoffintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse aller Positionen des Fonds) im Vergleich zum Index	Reduzierung der Kohlenstoffintensität des Portfolios im Vergleich zum Index, in %	51,91 %	49,12 %	40,59 %
Ausschluss von Emittenten, die Tabakprodukte herstellen	Anz. der aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße
Ausschluss von Emittenten, die Feuerwaffen und/oder Munition für Handfeuerwaffen herstellen, die für den Einzelhandelsverkauf an Zivilisten vorgesehen sind	Anz. der aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße
Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus dem Vertrieb (Großhandel oder Einzelhandel) von Schusswaffen und/oder Munition für Kleinwaffen für den zivilen Gebrauch erzielen	Anz. der aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße
Ausschluss von Emittenten, die gegen die 10 Prinzipien des UN Global Compact verstoßen haben	Anz. der aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße
Ausschluss von Emittenten, die Umsätze aus einer direkten Beteiligung an der Herstellung von Atomwaffen oder Atomwaffenkomponenten oder Trägerplattformen oder der Bereitstellung von Hilfsdienstleistungen in Verbindung mit Atomwaffen erzielen	Anz. der aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße
Ausschluss von Emittenten, die an der Herstellung kontroverser Waffen beteiligt sind oder anderweitig damit zu tun haben (wie oben beschrieben)	Anz. der aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße
Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus der Produktion und Förderung von Teersand (auch bekannt als Ölsand) erwirtschaften	Anz. der aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße
Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder der Stromerzeugung auf der Basis von Kraftwerkskohle erwirtschaften (wie vorstehend dargelegt)	Anz. der aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße

Anhang IV – Ergänzende Informationen (ungeprüft) Fortsetzung

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

Systematic Global SmallCap Fund (Fortsetzung)

Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus der Herstellung, dem Vertrieb, dem Einzelhandel und der Lieferung von Produkten im Zusammenhang mit Tabak erzielen	Anz. der aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße	Keine aktiven Verstöße
---	---------------------------	------------------------	------------------------	------------------------

¹Das ESG-Rating des Fonds war während des gesamten Referenzzeitraums höher als das Rating des Index, nachdem mindestens 20 % der Wertpapiere mit dem niedrigsten Rating aus dem Index ausgeschlossen wurden.

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die obige Tabelle enthält Informationen über die Performance der Nachhaltigkeitsindikatoren für die vorangegangenen Referenzzeiträume (siehe Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“).

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

Während des Bezugszeitraums hat der Fonds zur Erreichung seines Anlageziels 35,55 % seiner Positionen in nachhaltige Investitionen investiert.

Ökologische und soziale Ziele

Der Fonds hat in nachhaltige Investitionen investiert, die zu einer Reihe von ökologischen und/oder sozialen Zielen beigetragen haben, darunter alternative und erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vermeidung oder Verringerung von Umweltverschmutzung, Wiederverwendung und Recycling, Gesundheit, Ernährung, sanitäre Einrichtungen und Bildung sowie zu den Zielen der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung und andere nachhaltigkeitsbezogene Rahmenwerke („ökologische und soziale Ziele“).

Bewertung der Wirtschaftstätigkeit

Eine Investition wurde als zu einem ökologischen und/oder sozialen Ziel beitragend gewertet, wenn:

- (i) ein Mindestanteil der Geschäftstätigkeit des Emittenten zu einem ökologischen und/oder sozialen Ziel beigetragen hat; oder
- (ii) die Geschäftspraktiken des Emittenten zu einem ökologischen und/oder sozialen Ziel beigetragen haben.

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

Die vom Fonds während des Referenzzeitraums gehaltenen nachhaltigen Investitionen erfüllten die DNSH-Anforderungen (Do Not Significant Harm, Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen), wie sie in den geltenden Rechtsvorschriften definiert sind. BlackRock hat eine Reihe von Kriterien für nachhaltige Investitionen entwickelt, um zu beurteilen, ob ein Emittent oder eine Investition erhebliche Beeinträchtigungen verursacht. Investitionen, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen, gelten nicht als nachhaltige Investitionen.

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

Die Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAIs“) auf Nachhaltigkeitsfaktoren für jede Art von Anlage wurden anhand der firmeneigenen Methodik von BlackRock für nachhaltige Investitionen bewertet. Dabei wurden alle relevanten obligatorischen PAI-Indikatoren berücksichtigt, die in Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission aufgeführt sind. BlackRock hat Fundamentalanalysen und Datenquellen von Drittanbietern genutzt, um Investitionen mit nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren haben und erheblichen Beeinträchtigungen zu identifizieren. Bitte beachten Sie den nachstehenden Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“. Dort wird beschrieben, inwiefern der Fonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt hat.

- Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Während des Referenzzeitraums gehaltene nachhaltige Investitionen wurden im Hinblick auf mögliche nachteilige Auswirkungen sowie die Einhaltung der internationalen Standards der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und der Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte geprüft, einschließlich der Grundprinzipien und Rechte aus den acht Kernübereinkommen, die in der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation über grundlegende Prinzipien und Rechte bei der Arbeit festgelegt sind, und aus der Internationalen

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

Anhang IV – Ergänzende Informationen (ungeprüft) Fortsetzung

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

Systematic Global SmallCap Fund (Fortsetzung)

Charta der Menschenrechte. Emittenten oder Unternehmen, von denen angenommen wird, dass sie gegen diese Konventionen verstößen haben, gelten nicht als nachhaltige Investitionen.

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

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

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die folgende Tabelle enthält Informationen über die wichtigsten Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, die von diesem Fonds berücksichtigt werden. Der Fonds berücksichtigte die Auswirkungen der wichtigsten Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen durch die Bewerbung der oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale („E&S-Kriterien“) (siehe „Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?“). Der Anlageberater hat beschlossen, dass diese wichtigsten nachteiligen Auswirkungen im Rahmen der Anlageauswahlkriterien berücksichtigt wurden. Der spezifische Nachhaltigkeitsindikator des Fonds ist möglicherweise nicht in vollem Umfang mit der regulatorischen Definition der entsprechenden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen konform, die in Anhang 1 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 über technische Regulierungsstandards (Regulatory Technical Standards – „RTS“) dargelegt ist.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Nachhaltigkeitsindikatoren
Treibhausgas (THG)-Emissionen	Reduzierung der Kohlenstoffintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse aller Positionen des Fonds) im Vergleich zum Index
THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird	Reduzierung der Kohlenstoffintensität (Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatzerlöse aller Positionen des Fonds) im Vergleich zum Index
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind	Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus der Produktion und Förderung von Teersand (auch bekannt als Ölsand) erwirtschaften
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind	Ausschluss von Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus der Förderung von Kraftwerkskohle und/oder der Stromerzeugung auf der Basis von Kraftwerkskohle erwirtschaften, mit Ausnahme von „grünen Anleihen“ von diesen Emittenten, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie den Green Bond Principles der International Capital Markets Association entsprechen.
Verstöße gegen die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen und gegen die Leitsätze der OECD für multinationale Unternehmen	Ausschluss von Emittenten, die gegen die 10 Prinzipien des UN Global Compact verstößen haben
Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	Ausschluss von Emittenten, die an der Herstellung kontroverser Waffen beteiligt sind oder anderweitig damit zu tun haben (wie oben beschrieben)

Anhang IV – Ergänzende Informationen (ungeprüft) Fortsetzung

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

Systematic Global SmallCap Fund (Fortsetzung)



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigten wurden: Vom 1. September 2024 bis 31. August 2025.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Borgwarner Inc	Nicht-Basiskonsumgüter	0,83 %	USA
Tokyu Fudosan Holdings Corp	Immobilien	0,81 %	Japan
Technipfmc Plc	Energie	0,78 %	Vereinigtes Königreich
Curtiss Wright Corp	Industrie	0,76 %	USA
Primoris Services Corp	Industrie	0,72 %	USA
Comfort Systems Usa Inc	Industrie	0,70 %	USA
Tokyo Tatemono Ltd	Immobilien	0,68 %	Japan
Bawag Group Ag	Finanzen	0,67 %	Österreich
Mastec Inc	Industrie	0,66 %	USA
Flex Ltd	Informationstechnologie	0,66 %	USA
Sprouts Farmers Market Inc	Basiskonsumgüter	0,65 %	USA
Exbservice Holdings Inc	Industrie	0,64 %	USA
Amada Ltd	Industrie	0,64 %	Japan
Jones Lang Lasalle Inc	Immobilien	0,62 %	USA
Mgic Investment Corp	Finanzen	0,55 %	USA

Anhang IV – Ergänzende Informationen (ungeprüft) Fortsetzung

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

Systematic Global SmallCap Fund (Fortsetzung)

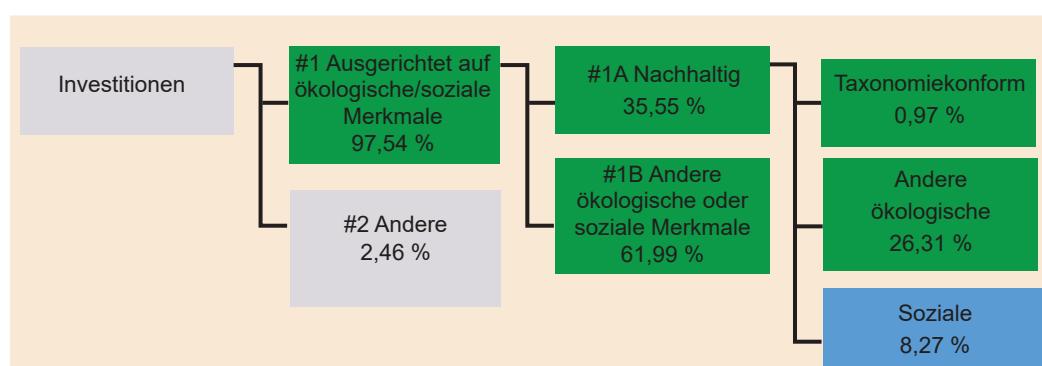


Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Für den Referenzzeitraum ist der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen in der folgenden Grafik dargestellt.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigten wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Der Prozentsatz der Taxonomiekonformität im obigen Diagramm stellt den Prozentsatz der Investitionen dar, die der Fonds in EU-taxonomiekonformen Aktivitäten durch nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel hält. Sie umfasst nicht die Taxonomiekonformität, die durch die anderen Investitionen des Fonds erreicht wurde. Die Taxonomiekonformität der Gesamtinvestitionen des Fonds ist dem Balkendiagramm unten zu entnehmen.

In der folgenden Tabelle ist die Vermögensallokation des Fonds für den aktuellen und die früheren Referenzzeiträume dargestellt.

Vermögensallokation	% der Investitionen		
	2025	2024	2023
#1 Ausgerichtet auf ökologische/soziale Merkmale	97,54 %	97,86 %	98,25 %
#2 Andere	2,46 %	2,14 %	1,75 %
#1A Nachhaltig	35,55 %	29,08 %	24,21 %
#1B Andere ökologische/soziale Merkmale	61,99 %	68,78 %	74,04 %
Taxonomiekonforme	0,97 %	1,68 %	0,00 %
Andere ökologische	26,31 %	19,86 %	16,51 %
Soziale	8,27 %	7,55 %	7,70 %

Anhang IV – Ergänzende Informationen (ungeprüft) Fortsetzung

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

Systematic Global SmallCap Fund (Fortsetzung)

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

In der folgenden Tabelle sind die Wirtschaftssektoren aufgeführt, in die der Fonds während des Referenzzeitraums investiert war.

Sektor	Teilsektor	% der Investitionen
Industrie	Investitionsgüter	14,48 %
Finanzen	Finanzdienstleistungen	7,34 %
Grundstoffe	Grundstoffe	6,28 %
Informationstechnologie	Software und Dienstleistungen	5,78 %
Gesundheitswesen	Pharma, Biotechnologie und Life Sciences	5,77 %
Finanzen	Banken	5,23 %
Gesundheitswesen	Gesundheitswesen, Geräte und Dienstleistungen	4,84 %
Informationstechnologie	Technische Hardware und Geräte	4,64 %
Nicht-Basiskonsumgüter	Nicht-Basiskonsumgüter, Vertrieb und Einzelhandel	4,32 %
Nicht-Basiskonsumgüter	Gebrauchsgüter	4,02 %
Nicht-Basiskonsumgüter	Verbraucherdienstleistungen	3,97 %
Immobilien	Immobilienverwaltung und -entwicklung	3,88 %
Industrie	Gewerbliche und professionelle Dienstleistungen	3,28 %
Immobilien	Aktien, Immobilieninvestmentgesellschaften (REITs)	3,25 %
Kommunikation	Medien und Unterhaltung	3,08 %
Informationstechnologie	Halbleiter und Halbleiterausrüstung	2,83 %
Basiskonsumgüter	Lebensmittel, Getränke, Tabak	2,13 %
Nicht-Basiskonsumgüter	Autos und Autoteile	2,11 %
Versorger	Versorger	1,99 %
Industrie	Transport	1,69 %
Kommunikation	Telekommunikation	1,64 %
Finanzen	Versicherung	1,53 %
Energie	Öl- und Gasanlagen und -dienstleistungen	1,42 %
Energie	Öl- und Gasexploration und -förderung	1,13 %
Basiskonsumgüter	Basiskonsumgüter, Vertrieb und Einzelhandel	1,03 %
Energie	Öl- und Gasraffination und -vermarktung	0,93 %
Energie	Öl- und Gaslagerung und -transport	0,40 %
Energie	Integrierte Öl- und Gasindustrie	0,02 %
Energie	Öl- und Gasbohrungen	0,02 %
Energie	Kohle und Brennstoffe	0,01 %

Anhang IV – Ergänzende Informationen (ungeprüft) Fortsetzung

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

Systematic Global SmallCap Fund (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

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

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



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

Für den Referenzzeitraum ist die Konformität der Investitionen des Fonds mit der EU-Taxonomie in den nachstehenden Abbildungen dargestellt.

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

Ja:

In fossiles Gas

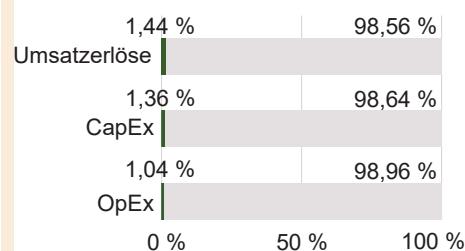
In Kernenergie

Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



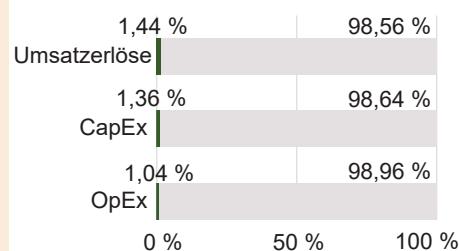
Taxonomiekonform: Fossiles Gas

Taxonomiekonform: Kernenergie

Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)

Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Taxonomiekonform: Fossiles Gas

Taxonomiekonform: Kernenergie

Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)

Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

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

Anhang IV – Ergänzende Informationen (ungeprüft) Fortsetzung

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

Systematic Global SmallCap Fund (Fortsetzung)

Taxonomiekonformität (einschließlich Staatsanleihen)	Umsatzerlöse	CapEx	OpEx
Taxonomiekonform: Fossiles Gas	0,00 %	0,00 %	0,00 %
Taxonomiekonform: Kernenergie	0,00 %	0,00 %	0,00 %
Taxonomiekonform: Ohne fossiles Gas und Kernenergie	1,44 %	1,36 %	1,04 %
Nicht taxonomiekonform	98,56 %	98,64 %	98,96 %

Taxonomiekonformität (ohne Staatsanleihen)	Umsatzerlöse	CapEx	OpEx
Taxonomiekonform: Fossiles Gas	0,00 %	0,00 %	0,00 %
Taxonomiekonform: Kernenergie	0,00 %	0,00 %	0,00 %
Taxonomiekonform: Ohne fossiles Gas und Kernenergie	1,44 %	1,36 %	1,04 %
Nicht taxonomiekonform	98,56 %	98,64 %	98,96 %

In Bezug auf den Referenzzeitraum wurden 0,00 % der Gesamtinvestitionen des Fonds in staatlichen Engagements gehalten.

Die vom Fonds während des Referenzzeitraums gehaltenen Investitionen trugen zu den folgenden Umweltzielen der EU-Taxonomie bei:

Umweltziele	% der Investitionen
Klimaschutz	1,13 %
Anpassung an den Klimawandel	0,30 %

Die in der vorstehenden Tabelle dargestellten Daten waren nicht Gegenstand einer Prüfung durch den Abschlussprüfer des Fonds oder einer Überprüfung durch einen Dritten. Die Bewertung der EU-Taxonomiekonformität basiert auf Daten eines Drittanbieters. Die Quelle dieser Daten ist eine Kombination aus äquivalenten und gemeldeten Daten. Gleichwertige Daten, die den technischen Kriterien der EU-Taxonomie entsprechen, generieren ein Ergebnis hinsichtlich Eignung und Konformität für die Unternehmen, für die wir keine Daten meldet haben.

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

Für den Referenzzeitraum waren die Investitionen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermögliche Tätigkeiten wie folgt:

	% der Investitionen
Übergangstätigkeiten	0,07 %
Ermögliche Tätigkeiten	0,62 %

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

In der folgenden Tabelle ist der prozentuale Anteil der Investitionen aufgeführt, die für den aktuellen und frühere Referenzzeiträume mit der EU-Taxonomie konform waren.

	% der Investitionen	2025	2024	2023
EU-Taxonomiekonform	1,44 %	1,95 %	0,00 %	

Anhang IV – Ergänzende Informationen (ungeprüft) Fortsetzung

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

Systematic Global SmallCap Fund (Fortsetzung)

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



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

In Bezug auf den Referenzzeitraum wurden 26,31 % der Investitionen des Fonds als nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel und nicht als mit der EU-Taxonomie konform klassifiziert.

Der Fonds investierte aus folgenden Gründen in nachhaltige Investitionen, die nicht mit der EU-Taxonomie konform waren: (i) Es ist Teil der Anlagestrategie des Fonds; (ii) Daten zur Bestimmung der Konformität mit der EU-Taxonomie waren nicht verfügbar; und/oder (iii) die zugrunde liegenden Wirtschaftstätigkeiten waren nach den verfügbaren technischen Prüfkriterien der EU-Taxonomie nicht zulässig oder erfüllten nicht alle Anforderungen, die in diesen technischen Prüfkriterien festgelegt sind.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

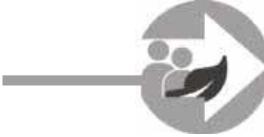
In Bezug auf den Referenzzeitraum wurden 8,27 % der Investitionen des Fonds als sozial nachhaltige Investitionen klassifiziert.



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

Die unter „#2 Andere Investitionen“ aufgeführten Investitionen umfassten Derivate, Barmittel und barmittelähnliche Instrumente, wobei diese Beteiligungen jedoch nicht mehr als 20 % ausmachten. Diese Investitionen wurden nur zu Anlagezwecken zur Verfolgung des (nicht ESG-bezogenen) Anlageziels des Fonds, zur Liquiditätssteuerung und/oder Absicherung verwendet.

Keine anderen vom Fonds gehaltenen Investitionen wurden im Hinblick auf einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz überprüft.



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

Der Anlageberater hat interne Qualitätskontrollen wie die Festlegung von Compliance-Regeln implementiert, um die Einhaltung der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale sicherzustellen. Der Anlageberater überprüft regelmäßig die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, um sicherzustellen, dass sie im Verhältnis zum Anlageuniversum des Fonds noch angemessen sind.

Werden Emittenten in Bezug auf eine gute Unternehmensführung als potenziell problematisch identifiziert, wird eine Überprüfung der Emittenten durchgeführt, um sicherzustellen, dass der Anlageberater, sofern er dieser externen Bewertung zustimmt, davon überzeugt ist, dass der Emittent Abhilfemaßnahmen ergriffen hat oder innerhalb eines angemessenen Zeitraums auf der Basis des direkten Dialogs des Anlageberaters mit dem Emittenten Abhilfemaßnahmen ergreifen wird. Der Anlageberater kann auch eine Reduzierung des Engagements in solchen Emittenten beschließen.

Anhang IV – Ergänzende Informationen (ungeprüft) Fortsetzung

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten (Fortsetzung)

Systematic Global SmallCap Fund (Fortsetzung)



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

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Für den Referenzzeitraum wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um die vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen; daher findet dieser Abschnitt keine Anwendung.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht zutreffend.