

ABN AMRO FUNDS

Abrégée sous le nom AAF

Une société d'investissement à capital variable en vertu de la loi
du Luxembourg

POUR LES DEMANDES D'INFORMATIONS

ABN AMRO FUNDS
49, avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

AVIS

Le présent Prospectus ne saurait être utilisé aux fins d'une offre ou sollicitation dans quelque pays ou sous quelques circonstances que ce soit dans lesquelles ladite offre ou ledit démarchage ne serait pas autorisé.

La Société est agréée en tant qu'Organisme de placement collectif en valeurs mobilières (OPCVM) au Luxembourg.

Elle est spécialement autorisée à distribuer ses actions au Luxembourg, en Belgique, en France, aux Pays-Bas et en Allemagne. Tous les compartiments et toutes les catégories ou sous-catégories d'actions ne sont pas nécessairement enregistrés dans ces pays. Il est essentiel qu'avant de souscrire leurs actions, les investisseurs potentiels s'assurent d'avoir pris connaissance des informations relatives aux compartiments, catégories ou sous-catégories d'actions autorisés pour distribution dans leur pays de résidence et des contraintes appliquées dans chacun de ces pays.

Compte tenu des dispositions des Règlements (UE) 833/2014 et 2022/398, la souscription d'actions dans tout compartiment de la Société ABN AMRO Funds est interdite à tout ressortissant russe ou biélorusse, à toute personne physique résidant en Russie ou en Biélorussie ou à toute personne morale, entité ou organisme établi en Russie ou en Biélorussie, à l'exception des ressortissants d'un État membre de l'Union européenne ainsi que des personnes physiques titulaires d'un titre de séjour temporaire ou permanent dans un État membre de l'Union européenne.

Les actions n'ont pas été, et ne seront pas, enregistrées en vertu de la Loi américaine sur les sociétés (U.S. Securities Act) de 1933 ou ne remplissent pas les conditions requises par les lois fédérales américaines ; elles ne peuvent être transférées, offertes ou vendues aux États-Unis d'Amérique (y compris dans leurs territoires ou possessions) ou à, ou au bénéfice, direct ou indirect d'un « R ressortissant américain » (comme défini par le Règlement S de la Loi américaine sur les sociétés de 1933) sauf en vertu d'un enregistrement ou d'une exemption applicable.

La Société n'est pas et ne sera pas enregistrée au titre de la Loi de 1940 et les investisseurs ne seront pas admissibles à l'enregistrement conformément à la Loi de 1940. Toute revente ou tout transfert d'actions aux États-Unis ou à un R ressortissant américain peut constituer une violation de la loi américaine et requiert le consentement écrit préalable de la Société. La Société se réserve toutefois le droit d'effectuer un placement privé de ses actions auprès d'un nombre limité ou d'une catégorie de R ressortissants américains. Toute revente ou tout transfert d'actions aux États-Unis ou à un R ressortissant américain peut constituer une violation de la loi américaine et requiert le consentement écrit préalable du Conseil d'administration de la Société. Les Souscripteurs d'actions seront tenus de certifier qu'ils ne sont pas des R ressortissants américains.

Le Conseil d'administration a le pouvoir d'imposer des restrictions sur la détention d'actions (et donc d'exiger le rachat des actions détenues par) ou transférées au bénéfice de, tout R ressortissant américain. Un tel pouvoir concerne toute personne semblant être en infraction avec les lois ou exigences de tout pays ou de toute autorité gouvernementale, ou toute ou toutes personnes, lorsque les circonstances (influençant directement ou indirectement ladite ou lesdites personnes, que ce soit individuellement ou conjointement avec d'autres personnes, liées ou non, ou dans toutes autres circonstances jugées pertinentes par le Conseil d'administration de la Société) sont, de l'avis du Conseil d'administration de la Société, susceptibles d'entraîner pour la Société tout préjudice que la Société n'aurait peut-être pas encouru ou subi dans d'autres circonstances.

Les actions n'ont pas été approuvées ou désapprouvées par la SEC, par les commissions fédérales des valeurs mobilières ou autres autorités de réglementation américaine et aucune des autorités susmentionnées n'a porté de jugement sur ou approuvé les mérites de cette offre, ou l'exactitude ou la pertinence de ces documents d'information. Toute déclaration contraire sera réputée illégale.

Les actionnaires qui deviendraient des R ressortissants américains devront en informer immédiatement la Société. Les actionnaires qui deviendraient des R ressortissants américains devront céder leurs actions à des personnes n'étant pas des R ressortissants américains. La Société se réserve le droit de racheter toutes les actions qui sont ou deviennent la propriété directe ou indirecte d'un R ressortissant américain ou si la détention des actions par une personne quelconque est illégale ou préjudiciable à la Société.

Les conditions de base de la FATCA, telles que transposées au Luxembourg par l'Accord intergouvernemental entre le Luxembourg et les États-Unis, ratifié par le Parlement du Luxembourg le 24 juillet 2015 (la « Loi FATCA du Luxembourg ») semblent inclure actuellement la Société en qualité d'EFE, laquelle pourra, à des fins de conformité, demander à ses actionnaires de fournir tout document attestant de leur situation fiscale et toutes autres informations nécessaires pour satisfaire les exigences de la législation susmentionnée.

Nonobstant toute autre stipulation figurant aux présentes et dans la mesure permise par les lois du Luxembourg, la Société aura le droit de :

- Retenir toute taxe ou toutes charges similaires qu'il est légalement requis de retenir, par effet de la loi ou autrement, eu égard à toute détention d'action de la Société ;
- Demander, à tout actionnaire ou titulaire bénéficiaire des actions, de lui fournir rapidement lesdites informations personnelles afin qu'elle puisse respecter toute loi applicable et/ou déterminer promptement le montant de la retenue à la source ;
- Divulguer lesdites informations personnelles à toute autorité fiscale ou réglementaire, susceptibles d'être requises par la loi ou l'autorité en question ;
- Retenir le paiement des dividendes ou des produits de rachat dû à un actionnaire jusqu'à ce qu'elle possède les informations suffisantes pour déterminer le montant correct à retenir.

Par ailleurs, la Société confirme par les présentes qu'elle est un Établissement financier déclarant du Luxembourg, comme stipulé dans la Loi FATCA du Luxembourg et qu'elle est enregistrée aux fins de la FATCA auprès de l'administration fiscale des États-Unis (IRS, Internal Revenue Service) afin d'obtenir un numéro d'identification intermédiaire mondial (« NIIM ») ; en outre, la Société négocie uniquement avec des intermédiaires financiers professionnels dûment enregistrés sous un NIIM.

De plus, nul ne saurait émettre des informations pour consultation publique, autres que celles présentées dans le Prospectus ou les documents y mentionnés. Le Conseil d'administration de la Société répond de l'exactitude des informations contenues dans le Prospectus à la date de sa publication.

En dernier lieu, le Prospectus peut être actualisé pour refléter le lancement ou la clôture de compartiments ou toutes informations importantes relatives à la structure de la Société ou à ses méthodes opérationnelles. Par conséquent, il est recommandé aux souscripteurs de demander à consulter les tout derniers documents comme indiqué à la section « Informations destinées aux actionnaires ». Il est également recommandé aux souscripteurs de s'informer sur les lois et réglementations (comme celles concernant la fiscalité et le contrôle des changes) applicables à la souscription, à l'achat, à la détention et au rachat d'actions dans leur pays d'origine, dans lequel ils ont leur résidence ou leur domicile.

Le Prospectus sera uniquement valide s'il est accompagné du dernier rapport annuel audité ainsi que du dernier rapport intermédiaire si celui-ci est plus récent que le rapport annuel.

En cas de discordance ou d'ambiguïté sur la signification d'un mot ou d'une phrase dans toute traduction du Prospectus, la version anglaise prévaudra.

SOMMAIRE

| | |
|---|------------|
| Terminologie..... | 10 |
| LIVRE I DU PROSPECTUS..... | 17 |
| Dispositions d'ordre général..... | 18 |
| Administration et gestion..... | 19 |
| Politique, Objectifs, Restrictions et Techniques d'investissement..... | 22 |
| Les Actions..... | 24 |
| Valeur nette d'inventaire..... | 30 |
| Dispositions fiscales..... | 33 |
| Assemblées générales et informations à l'attention des Actionnaires..... | 35 |
| Annexe 3 – Risques d'investissement..... | 49 |
| Annexe 4 – Cogestion..... | 56 |
| Annexe 5 – Procédures de fusion, clôture, liquidation et scission..... | 57 |
| LIVRE II DU PROSPECTUS-GESTIONNAIRE UNIQUE..... | 58 |
| ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities..... | 59 |
| ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities..... | 63 |
| ABN AMRO Funds Aristotle US Equities..... | 66 |
| ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds..... | 70 |
| ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds..... | 74 |
| ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds..... | 77 |
| ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds..... | 81 |
| ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities..... | 85 |
| ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities..... | 89 |
| ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities..... | 92 |
| ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds..... | 97 |
| ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds..... | 101 |
| ABN AMRO Funds Candriam European ESG Convertibles..... | 104 |
| ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities..... | 108 |
| ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities..... | 111 |
| ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities..... | 114 |
| ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles..... | 117 |
| ABN AMRO Funds Candriam Global Dividend Equities..... | 120 |
| ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds..... | 123 |
| ABN AMRO Funds Candriam Total Return Global Bonds..... | 126 |
| ABN AMRO Funds Candriam Total Return Global Equities..... | 129 |
| ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities..... | 132 |
| ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities..... | 135 |
| ABN AMRO Funds Global ESG Equities..... | 138 |
| ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities..... | 141 |
| ABN AMRO Funds Insight Euro Aggregate Bonds..... | 144 |
| ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds..... | 147 |
| ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged..... | 150 |
| ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds..... | 156 |
| ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged..... | 159 |
| ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities..... | 162 |
| ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities..... | 165 |
| ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities..... | 168 |
| ABN AMRO Funds Numeric Emerging Markets Equities..... | 171 |
| ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities..... | 174 |
| ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds..... | 179 |
| ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities..... | 185 |
| ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities..... | 188 |
| ABN AMRO Funds Pzena European Equities..... | 191 |
| ABN AMRO Funds Pzena US Equities..... | 195 |
| ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds..... | 199 |
| ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities..... | 202 |
| ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds..... | 205 |
| ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged..... | 208 |
| ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities..... | 211 |
| LIVRE II DU PROSPECTUS – FONDS SOUS MANDAT..... | 214 |
| ABN AMRO Funds Fund of Mandates-Pacific Equities..... | 215 |
| ABN AMRO Funds Fund of Mandates Emerging Market Equities..... | 218 |
| ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds..... | 221 |
| ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged..... | 224 |
| ABN AMRO Funds Fund of Mandates North American Equities..... | 227 |
| ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds..... | 230 |
| ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds..... | 233 |
| LIVRE II DU PROSPECTUS – PROFILS..... | 236 |
| ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive..... | 237 |
| ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive..... | 240 |
| ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderatly Defensive..... | 243 |
| ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderatly Aggressive..... | 246 |
| ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive..... | 249 |
| ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive..... | 252 |
| ABN AMRO Funds Comfort Invest II..... | 255 |
| ABN AMRO Funds Comfort Invest III..... | 258 |
| ABN AMRO Funds Comfort Invest IV..... | 261 |

| | |
|--|-----|
| ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Defensief | 264 |
| ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Defensief | 266 |
| ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Defensief | 268 |
| ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Offensief | 270 |
| ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Offensief | 272 |
| ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Offensief | 274 |
| ABN AMRO Funds Global Balanced | 276 |
| ABN AMRO Funds Flexible Allocation Fund | 279 |
| ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities | 282 |
| ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities | 285 |
| ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds | 288 |
| ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds | 291 |
| Appendix 1 - Règlement SFDR et Règlement européen sur la taxonomie | 294 |

Une section Informations est disponible pour chaque compartiment particulier. Cette section précise la politique et l'objectif d'investissement de chaque compartiment, les caractéristiques des actions, leur devise de comptabilité, le jour où s'effectue la valorisation, les méthodes de souscription, de rachat ou de conversion, et s'il y a lieu, les données historiques et autres caractéristiques spécifiques du compartiment en question. Il est rappelé aux investisseurs que, sous réserve de dispositions contraires stipulées dans le Livre II, les réglementations générales stipulées dans le Livre I s'appliqueront à tous les compartiments.

INFORMATIONS D'ORDRE GENERAL

SIÈGE SOCIAL

ABN AMRO Funds
49, avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

CONSEIL D'ADMINISTRATION DE LA SOCIÉTÉ

Président

M. François-Xavier GENNETAIS, Président directeur général, ABN AMRO Investment Solutions, Paris

Membres

M. Adriaan KOOTSTRA, Directeur du Fonds mondial, ABN AMRO Private Banking
Mme Axelle FERREY, Directrice du personnel du CEO – COO, DLA Piper
Mme Elisa ALONSO SANZ, Directrice d'exploitation et membre exécutive du Conseil d'administration, ABN AMRO Investment Solutions, Paris
M. Olivier LEGUAY, Directeur administratif, ABN AMRO Investment Solutions, Paris
M. Werner WEYNAND, Administrateur indépendant

Directeur général

M. François-Xavier GENNETAIS, Président directeur général, ABN AMRO Investment Solutions, Paris

SOCIÉTÉ DE GESTION

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

ABN AMRO Investment Solutions est une société constituée en vertu du droit français, enregistrée auprès de l'AMF en tant que société de gestion de portefeuille d'OPCVM et autorisée par la CSSF à offrir des services de gestion de portefeuille collectif aux OPCVM au Luxembourg, avec la liberté de fournir des services conformément aux dispositions prévues par la Directive 2009/65.

ABN AMRO Investment Solutions, en tant que société de gestion (la « **Société de gestion** ») de ABN AMRO Funds, exécute les tâches d'administration, de gestion de portefeuille et de commercialisation.

ABN AMRO Investment Solutions est une société de gestion d'investissement de ABN AMRO Group. ABN AMRO Investment Solutions est entièrement détenue par ABN AMRO Bank NV.

LE CONSEIL D'ADMINISTRATION DE LA SOCIÉTÉ DE GESTION

Président

M. François-Xavier GENNETAIS, Président directeur général, ABN AMRO Investment Solutions, Paris

Membres

M. Christophe BOUCHER, Directeur des investissements, ABN AMRO Investment Solutions, Paris
Mme Elisa ALONSO-SANZ, Directrice d'exploitation, ABN AMRO Investment Solutions, Paris

CALCUL DE LA VNI

STATE STREET BANK INTERNATIONAL GMBH, SUCCURSALE LUXEMBOURGEOISE
49 avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

AGENT DE TRANSFERT ET DE REGISTRE

STATE STREET BANK INTERNATIONAL GMBH, SUCCURSALE LUXEMBOURGEOISE
49 avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

DÉPOSITAIRE/AGENT PAYEUR

STATE STREET BANK INTERNATIONAL GMBH, SUCCURSALE LUXEMBOURGEOISE
49 avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

GESTIONNAIRES D'INVESTISSEMENT

ABN AMRO Investment Solutions a été désignée par le Conseil d'administration en tant que Société de gestion ; elle est à ce titre responsable de la gestion des investissements de chacun des compartiments de la Société.

ABN AMRO Investment Solutions, en sa qualité de Société de gestion, peut déléguer (en partie ou en totalité) les tâches de gestion de portefeuille des compartiments, entre autres, « Fonds sous mandat », « Gestionnaire unique », « Profil » et « Indice » aux gestionnaires d'investissement externes suivants :

- Alliance Bernstein L.P.
501 Commerce Street, Nashville, TN 37203, États-Unis d'Amérique
Une société constituée en vertu du droit américain, créée en janvier 1971
- Amundi Asset Management SAS
90, boulevard Pasteur, F-75015 Paris, France
Une société constituée en vertu du droit français
- Amundi Ireland Limited
1 George's Quay Plaza's, George's Quay, Dublin 2, Irlande
Une société constituée en vertu du droit irlandais, membre d'Amundi Group
- Aristotle Capital Management, LLC
11100 Santa Monica Boulevard Suite 1700, Los Angeles, CA 90025 États-Unis d'Amérique
Une société constituée en vertu du droit américain, créée en 2006
- Barings LLC
300 South Tryon Street, suite 2500, Charlotte, NC 28202 États-Unis d'Amérique.
Une société constituée en vertu du droit américain
- Baring Asset Management Limited
20 Old Bailey, Londres EC4M 7BF, Royaume-Uni
Une société constituée en vertu du droit britannique
- BlueBay Asset Management LLP
77 Grosvenor Street, Londres W1K 3JR, Royaume-Uni
Une société constituée en vertu du droit britannique
- Boston Common Asset Management, LLC
200 State Street, 7th Floor, Boston, MA 02109 États-Unis d'Amérique
Une société constituée en vertu du droit américain
- Boston Trust Walden Inc.
1 Beacon Street, Boston MA 02108-3116, États-Unis d'Amérique
Une société constituée en vertu du droit américain, créée en 1974
- Candriam
19-21 route d'Arlon, 8009 Strassen, Grand-Duché de Luxembourg
Une société constituée en vertu du droit britannique et du droit luxembourgeois, créée le 8 août 1991, membre de Candriam Group, qui, sur approbation de la Société de gestion, délègue ses tâches de Gestion de portefeuille à :
 - Candriam UK,
200 Aldersgate St, Barbican, Londres EC1A 4HD, Royaume-Uni
Couverte en tant que succursale britannique par la réglementation de l'entité luxembourgeoise, créée le 08/05/2012, membre de Candriam Group
- EdenTree Investment Management Limited
Benefact House, 2000 Pioneer Avenue, Gloucester Business Park, Brockworth, Gloucester, Royaume-Uni, GL3 4AW
Une société à responsabilité limitée établie en vertu des lois d'Angleterre et du pays de Galles
- Goldman Sachs Asset Management International
Plumtree Court, 25 Shoe Lane, Londres, EC4A 4AU, Royaume-Uni
Une société constituée en vertu du droit britannique
- Impax Asset Management, LLC
30 Penhallow Street, Suite 400, Portsmouth, NH 03801, États-Unis d'Amérique
Une société constituée en vertu du droit américain.
- Insight Investment Management (Global) Limited
160 Queen Victoria Street, EC4V 4LA, Londres, Royaume-Uni
Une société constituée en vertu du droit britannique, membre de BNY Mellon Group
- J.P. Morgan Asset Management (Europe) S.à r.l
6, route de Trèves, Senningerberg, L-2633 Luxembourg
Une société constituée en vertu du droit luxembourgeois
- Kempen Capital Management N.V.
Beethovenstraat 300 - 1077 WZ Amsterdam, Pays-Bas
Une société constituée en vertu du droit néerlandais
- Liontrust Investment Partners LLP
2 Savoy Court, Londres, WC2R 0EZ, Royaume-Uni
Une société constituée en vertu du droit britannique
- M&G Investment Management Limited
10 Fenchurch Avenue, Londres EC3M 5AG, Royaume-Uni
Une société constituée en vertu du droit britannique
- NN Investment Partners B.V.
Schenkkade 65, 2595 AS, La Haye, Pays-Bas
Une société constituée en vertu du droit néerlandais

- Numeric Investors LLC
200 Pier Four Boulevard, Boston MA 02210, États-Unis d'Amérique
Une société constituée en vertu du droit américain
 - Parnassus Investments
1, Market Street, Suite 1600, San Francisco, CA 94105, États-Unis d'Amérique
Une société constituée en vertu du droit américain
 - PGIM Inc.
655 Broad Street, Newark, NJ 07102, États-Unis d'Amérique
Une société constituée en vertu du droit américain
 - Principal Global Investors, LLC
801 Grand Avenue, Des Moines, Iowa 50392, États-Unis d'Amérique
Une société constituée en vertu du droit américain, créée en octobre 1998, filiale de Principal Financial Group
 - Pzena Investment Management, LLC
320 Park Avenue, New York, N.Y. 10022, États-Unis d'Amérique.
Une société constituée en vertu du droit américain le 27 novembre 1995
 - RBC Global Asset Management (UK) Limited
77 Grosvenor Street, Londres, W1K 3JR, Royaume-Uni
Une société constituée en vertu du droit britannique
 - Robeco Institutional Asset Management B.V.
Coolingsingel 120, 3011 AG- Rotterdam, Pays-Bas
Une société constituée en vertu du droit néerlandais, créée en 1929
 - Sands Capital Management, LLC
1000 Wilson Boulevard, Suite 3000, Arlington, Virginie 22209, États-Unis d'Amérique
Une société constituée en vertu du droit américain
 - Schroder Investment Management Ltd
1 London Wall Place, Londres EC2Y 5AUAU, Royaume-Uni
Une société constituée en vertu du droit britannique, créée en 2001
 - The Putnam Advisory Company, LLC
100 Federal Street, Boston, Massachusetts 02110, États-Unis d'Amérique
Une société constituée en vertu du droit américain, créée en décembre 2000
 - Walter Scott & Partners Limited
1 Charlotte Square Édimbourg, EH2 4DR, Royaume-Uni
Une société constituée en vertu du droit écossais, créée en 1983
- Les investisseurs peuvent demander une liste à jour des gestionnaires d'investissement, comme décrit à la section « Administration et gestion » du Prospectus.

CONSEILLERS

- ABN AMRO Bank N.V. Succursale belge
Borsbeeksebrug 30, 2600 Berchem, Belgique
Une société constituée en vertu du droit belge
- ABN AMRO Bank N.V.
Gustav Mahlerlaan 10, 1082 PP Amsterdam, Pays-Bas
Une société constituée en vertu du droit néerlandais

COMMISSAIRE AUX COMPTES

- PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
2, rue Gerhard Mercator, B.P. 1443, L-1014 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

AGENTS LOCAUX

En Belgique

- CACEIS Belgium S.A., Avenue du Port 86 C b320, B-1000 Bruxelles (*agent financier*)

En France

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

En Allemagne

- State Street Bank GmbH, Agent Fund Trading, Solmsstrasse 83, 60486 Francfort (*agent payeur et d'information*)

En Autriche

- Société Générale, Succursale de Vienne, Prinz-Eugen-Strasse 8-10/5/TOP 11, A-1040 Vienne, Autriche (*agent payeur et d'information*)

En Suisse

- CACEIS Bank, Montrouge, succursale de Nyon, 35 Route de Signy, CH-1260 Nyon, Suisse (*agent payeur*)
- CACEIS (Switzerland) SA, 35 Route de Signy, CH-1260 Nyon, Suisse (*agent de représentation*)

Au Royaume-Uni

- Société Générale Securities Services, SG House, 41 Tower Hill, Londres EC3N 4SG, Royaume-Uni (*agent de services, « facilities »*)

En Italie

- Allfunds Bank S.A.U. – Succursale di Milano, via Bocchetto 6, 20123 Milan, Italie (*agent payeur*)

Au Danemark

- SKANDINAVISKA ENSKILADA BANKEN, Bernstorffsgade 50, 1577 Copenhague V, Danemark (*agent payeur*)

En Suède

- Skandinaviska Enskilada Banken, Kungsträdgårdsgatan 8, SE-106 40 Stockholm, Suède (*agent payeur*)

STATUTS CONSTITUTIFS

La Société a été constituée le 17 novembre 2000 et un avis a été publié dans le Mémorial, Recueil Spécial des Sociétés et Associations (le « Mémorial »).

Les statuts de la Société (les « **Statuts** ») ont été modifiés à plusieurs reprises et dernièrement lors de l'Assemblée générale extraordinaire du 30 juillet 2021.

La dernière version des Statuts a été déposée auprès du Recueil Électronique des Sociétés et Associations du Luxembourg et toute partie intéressée peut la consulter et en obtenir une copie (sur le site Internet www.rcs.lu).

TERMINOLOGIE

Dans le présent document, les termes suivants auront le sens suivant : La terminologie ci-dessous est une liste de termes génériques. Certains d'entre eux peuvent par conséquent ne pas être employés dans le présent document.

| | |
|--|--|
| AAF : | Nom abrégé pour ABN AMRO Funds |
| <u>Investissements – rendement absolu :</u> | Investissements effectués dans l'objectif de générer des rendements positifs en employant des techniques de gestion d'investissements qui diffèrent de celles des fonds communs traditionnels, telles que la vente à découvert, les contrats à terme standardisés (futures), les options, les dérivés, l'arbitrage et l'effet de levier |
| <u>ABS/MBS :</u> | Asset-Backed Securities/Mortgage-Backed Securities (Titres adossés à des actifs/Titres adossés à des crédits hypothécaires) |
| <u>Devise de comptabilité :</u> | Devise dans laquelle les actifs d'un compartiment sont exprimés à des fins de comptabilité, qui peut différer de la devise de valorisation de la catégorie d'actions |
| <u>Négociation active :</u> | Souscription, conversion ou rachat dans le même compartiment sur une courte période et impliquant des montants substantiels, habituellement dans le but de générer un bénéfice rapide. Cette activité est préjudiciable pour les autres actionnaires étant donné qu'elle affecte la performance du compartiment et perturbe la gestion des actifs |
| <u>ADR :</u> | Certificats américains de dépôt (American Depositary Receipts) |
| <u>Investissements alternatifs :</u> | Investissements qui ne correspondent pas aux catégories d'actifs traditionnelles telles que les actions, titres de créance et liquidités : ils incluent les fonds spéculatifs, les contrats à terme standardisés (futures) gérés, les investissements immobiliers, les investissements en matières premières, les produits indexés sur l'inflation et les contrats sur dérivés. Les stratégies d'investissements alternatifs peuvent suivre les stratégies suivantes : « Equity Long/Short » (positions longues/courtes sur actions), « Equity Market Neutral » (neutre au marché actions), « Convertible Arbitrage » (arbitrage des obligations convertibles), « Fixed Income Arbitrage » (arbitrage de la courbe de rendements ou des spreads [écarts de taux] d'obligations d'entreprises), « Global Macro » (macroéconomique mondiale), « Distressed Securities » (titres en difficulté), « Multi-strategy » (multi-stratégie), « Managed Futures » (contrats futures gérés), « Take-over / merger arbitrage » (arbitrage des OPA/fusions), « Volatility arbitrage » (arbitrage de la volatilité), « Total Return » (rendement total). |
| <u>AMF :</u> | <i>Autorité des Marchés Financiers</i> , l'autorité réglementaire en France |
| <u>Investisseurs autorisés :</u> | Investisseurs spécialement approuvés par le conseil d'administration de la Société |
| <u>Garanties E/S de base :</u> | Ce concept, introduit par le SFDR, concerne les fonds d'investissement qui incluent des caractéristiques et/ou des objectifs ESG dans leur processus d'investissement ; l'idée est de considérer (respecter ou expliquer) des garanties E/S de base pour éviter d'investir dans les pires pratiques environnementales, sociales, en matière de droits de l'homme et de gouvernance. Tous les compartiments qui ne relèvent pas de l'article 8 ou de l'article 9 du SFDR sont tenus de se conformer à la liste des exclusions minimales de la Société de gestion. La liste (appelée l'ensemble 1 dans la Politique d'investissement durable de la Société de gestion) est régulièrement mise à jour par la Société de gestion et partagée avec le Gestionnaire de portefeuille d'investissement délégué. La liste se compose d'activités, de sociétés et de pays considérés comme gravement controversés (producteurs de tabac, sociétés non conformes au Pacte mondial des Nations Unies, pays sous embargo) |
| <u>Indice de référence :</u> | Indice de référence qui donne un point de référence pour le calcul de la performance du compartiment |
| <u>Règlement sur les indices de référence :</u> | Règlement (UE) 2016/1011 du Parlement européen et du Conseil du 8 juin 2016 concernant les indices utilisés comme indices de référence dans le cadre d'instruments et de contrats financiers ou pour mesurer la performance de fonds d'investissement |
| <u>Conseil d'administration ou Conseil :</u> | Le conseil d'administration de la Société |
| <u>CDO :</u> | Collateralized debt obligation (titre de créance collatéralisé) |
| <u>CDS :</u> | Swap (contrat d'échange) de défaut de crédit |
| <u>Circulaire 08/356 :</u> | Circulaire émise par la CSSF le 4 juin 2008, concernant les règles applicables aux organismes de placement collectif lorsqu'ils emploient certaines techniques et certains instruments basés sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire. Ce document est disponible sur le site Internet de la CSSF (www.cssf.lu) |
| <u>Circulaire 11/512 :</u> | Circulaire émise par la CSSF le 30 mai 2011, concernant a) la présentation des modifications réglementaires principales en matière de gestion du risque faisant suite à la Réglementation 10-4 de la CSSF et aux clarifications de l'AEMF ; b) une clarification supplémentaire apportée par la CSSF sur les règles en matière de gestion du risque ; c) la définition du contenu et de la forme du processus de gestion des risques devant être communiquée à la CSSF. Ce document est disponible sur le site Internet de la CSSF (www.cssf.lu) |
| <u>ChinaClear :</u> | China Securities Depository and Clearing Corporation Limited |
| <u>Investissements en matières premières :</u> | Investissements dans des instruments basés sur les matières premières |
| <u>Nom de la Société :</u> | ABN AMRO Funds |
| <u>CSRC :</u> | China Securities Regulatory Commission (Commission chinoise de réglementation des valeurs mobilières) |
| <u>CSSF :</u> | Commission de Surveillance du Secteur Financier, l'autorité de réglementation des OPC dans le Grand-Duché de Luxembourg |

| | |
|--|--|
| Devises : | EUR : Euro USD : Dollar américain GBP : Livre sterling SEK : Couronne suédoise |
| | Ou toute autre devise que le Gestionnaire peut décider d'ajouter de temps à autre |
| Loi sur la protection des données : | Règlement n° 2016/679 du 27 avril 2016 relatif à la protection des personnes physiques à l'égard du traitement des données à caractère personnel et à la libre circulation de ces données |
| Marchés développés : | Pays faisant partie de l'univers des Marchés développés tels que définis par MSCI Inc. |
| Directive 78/660 : | Directive du Conseil européen 78/660/CEE du 25 juillet 1978 concernant les comptes annuels de certaines formes de sociétés, telle qu'amendée |
| Directive 83/349 : | Directive du Conseil européen 83/349/CEE du 13 juin 1983 concernant les comptes consolidés, telle qu'amendée |
| Directive 2003/48 : | Directive du Conseil européen 2003/48/CE du 3 juin 2003 sur l'imposition des revenus d'épargne sous forme de paiements d'intérêts |
| Directive 2004/39 : | Directive du Conseil européen 2004/39/CE du 21 avril 2004 sur les marchés d'instruments financiers |
| Directive 2009/65 : | Directive du Conseil européen 2009/65/CE du 13 juillet 2009 portant sur la coordination des dispositions législatives, réglementaires et administratives concernant les organismes de placement collectif en valeurs mobilières (telle que modifiée par la Directive 2014/91/UE) |
| Actifs « distressed » (en difficulté) : | Titres obligataires dotés d'une notation inférieure à « CCC » et supérieure à « D » par Standard & Poor's ou une agence de notation équivalente. |
| DNSH | Le principe consistant à ne pas causer de préjudice important (en anglais, « Do Not Significantly Harm » ou « DNSH »), introduit par le SFDR, s'applique à l'« Art. 9 » – produits d'investissement durable. Le produit d'investissement ne doit pas causer de préjudice important à d'autres objectifs environnementaux ou sociaux. L'impact doit donc être mesurable et l'impact final doit être au moins neutre et globalement positif. |
| DPM : | Gestion de portefeuille discrétionnaire |
| EDS : | Swap (contrat d'échange) de défaut d'action |
| EEE : | Espace économique européen |
| Marchés émergents : | Pays faisant partie de l'univers des Marchés émergents et des Marchés frontières tels que définis par MSCI Inc. |

Questions environnementales, sociales et de gouvernance :

| | |
|------------------------------------|--|
| Questions environnementales | Problématiques liées à la qualité et au fonctionnement de l'environnement naturel et des écosystèmes. Sont incluses, entre autres, les problématiques suivantes : perte de la biodiversité, émissions de gaz à effet de serre, changement climatique, énergies renouvelables, efficacité énergétique, pollution atmosphérique, pollution de l'eau ou des ressources, ainsi que leur épuisement, gestion des déchets, appauvrissement de la couche d'ozone stratosphérique, évolution de l'utilisation des sols, acidification des océans. |
| Questions sociales | Problématiques liées aux droits, au bien-être et aux intérêts des personnes et des communautés. Sont incluses, entre autres, les problématiques suivantes : violation des droits de l'Homme, conditions de travail dans la chaîne d'approvisionnement, violation des droits des enfants, esclavage et travail forcé, conditions sanitaires et de sécurité sur le lieu de travail, liberté d'association et d'expression, gestion du capital humain et relations avec les employés, diversité femmes-hommes, relations avec les communautés locales, activités dans les zones de conflit, santé et accès aux médicaments, protection des consommateurs. |
| Questions de gouvernance | Problématiques liées à la gouvernance des sociétés et des autres entités en portefeuille. Dans le cadre d'actions cotées, ces problématiques peuvent inclure, entre autres : structure, taille, compétences et indépendance du conseil d'administration, ainsi que sa diversité femmes-hommes, rémunération des cadres, droits des actionnaires, interactions avec les parties prenantes, déclaration des informations, éthique professionnelle, lutte contre la corruption et les pots-de-vin, processus de contrôle interne et de gestion des risques, et, de manière générale, questions relatives aux relations entre la direction de l'entreprise, son conseil d'administration, ses actionnaires et ses parties prenantes. Les questions de gouvernance peuvent également comprendre la stratégie commerciale, tant sur le plan environnemental que social, ainsi que la procédure de mise en place de la stratégie. Concernant les catégories d'actifs non cotés, les questions de gouvernance peuvent inclure la gouvernance des fonds et notamment les pouvoirs des comités consultatifs, les problématiques liées à l'évaluation, la structure des commissions, etc. |

Fournisseurs de données ESG de la Société de gestion

Sustainalytics

La Société de gestion a élaboré des outils de contrôle intégrant les données environnementales, sociales et de gouvernance fournies par Sustainalytics.

Sustainalytics est une agence de notation orientée sur le développement durable, agissant principalement en Europe et en Amérique du Nord, qui fournit des informations quantitatives et qualitatives extra-financières sur les sociétés, les gouvernements et les institutions publiques partout dans le monde.

Sustainalytics fournit des scores de risque ESG fondés sur sa propre analyse des grands enjeux ESG et des sous-critères sous-jacents.

Approche du risque ESG au niveau des entreprises (investissement dans des « titres d'entreprises ») :

Cette approche du risque ESG distingue les risques ESG gérables (risques gérés et écarts de gestion) des risques ESG ingérables. La notation du risque ESG se compose de risques ESG non gérés qui ont été identifiés comme des écarts (écarts de gestion par rapport aux normes des groupes de pairs) et/ou comme des risques ingérables (par exemple, en raison de la spécificité de l'activité ou de la pression réglementaire).

Cette décomposition du risque rend le résultat de la notation beaucoup plus réaliste et significatif du point de vue de l'importance des enjeux ESG (y compris une dimension prospective).

Les Enjeux ESG majeurs qui sous-tendent la notation du risque ESG sont regroupés en fonction des thèmes suivants : gouvernance d'entreprise, accès aux services de base, lutte contre la corruption et les pots-de-vin, éthique commerciale, relations avec les communautés, confidentialité et sécurité des données, émissions, effluents et production de déchets, émissions de carbone des opérations, émissions de carbone des produits et services, impacts environnementaux et sociaux des produits et services, droits de l'homme (employés, chaîne d'approvisionnement), capital humain, utilisation des sols et biodiversité (opérations et chaîne d'approvisionnement), santé et sécurité, intégration des critères ESG dans les finances, gouvernance des produits, résilience et utilisation des ressources (dans l'entreprise et la chaîne d'approvisionnement).

Approche des risques ESG au niveau des pays (investissements dans des « titres d'État ») :

La notation du risque pays mesure le risque pour la prospérité et le développement économique à long terme d'un pays en évaluant la richesse nationale d'un pays et sa capacité à utiliser et gérer cette richesse de manière efficace et durable.

La notation mesure la richesse nationale constituée de capital naturel et produit, de capital humain et de capital institutionnel, ainsi que la capacité d'un pays à utiliser et gérer ces capitaux de manière efficace et durable, déterminée par sa performance ESG, ses tendances ESG et ses événements ESG. Le score agrégé comprend un score de richesse et un score de facteurs de risque ESG correspondant à ces deux composantes.

Les principales questions qui sous-tendent la notation des pays sont regroupées selon les facteurs suivants : Énergie et changement climatique, utilisation des ressources, gouvernance, besoins fondamentaux, santé et bien-être, équité et opportunités, solidité des institutions, droits et libertés, paix et sécurité.

Échelle : le score va de 0 à 100 et distingue cinq niveaux de risque : négligeable (<10), faible (de 10 à 20), moyen (de 20 à 30), élevé (de 30 à 40) et sévère (>40). À noter que plus la note de risque ESG est basse, plus le niveau de risque ESG est bas, et plus l'émetteur sera en mesure de traiter les questions de durabilité à l'avenir (et donc, plus l'impact attendu des risques de durabilité sur la valeur de l'entreprise sera faible).

Controverses

Une controverse est motivée par les événements et engendre des impacts ESG négatifs sur l'entreprise. Les controverses jouent un rôle important dans la notation du risque ESG, en la rendant plus sensible aux nouvelles informations entre les mises à jour des notations axées sur les déclarations. Sustainalytics évalue les controverses par thèmes pertinents sur une échelle de 0 (aucune) à 5 (grave).

La Société de gestion a pour objectif d'éviter les controverses graves au sein de ses portefeuilles car nous souhaitons préserver leur réputation et éviter tout impact financier négatif lié aux risques ESG. Les ensembles d'exclusions mis en place devraient protéger les portefeuilles de la Société de gestion de ce risque.

Sustainalytics met à disposition les outils suivants, que l'équipe d'analystes de la Société de gestion utilisera essentiellement afin de consulter et de récupérer les données quantitatives et qualitatives des différents émetteurs et les analyses plus générales concernant les questions environnementales, sociales et de gouvernance :

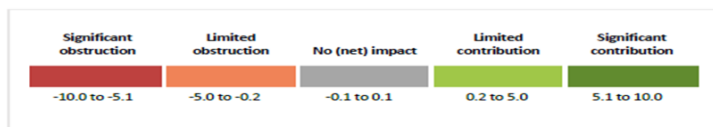
- l'outil « Recherche de sociétés », qui donne accès à des analyses sur les différents émetteurs couverts par Sustainalytics ;
- l'outil « Portefeuille », qui permet d'analyser des portefeuilles types ;
- l'outil « Sélection », qui permet de paramétrer les critères de sélection (par secteur d'activités ou par seuil) ;
- l'outil « Rapports », qui permet de générer des fichiers Excel ou au format .csv pouvant être intégrés directement aux outils internes ; ou
- l'outil « Centre de connaissances », qui informe des dernières mises à jour et évolutions concernant les questions environnementales, sociales et de gouvernance.

La Société de gestion a mis en place différents contrôles afin de s'assurer que les notes ESG sont conformes à la politique d'investissement durable du gestionnaire de fonds de chaque compartiment.

ISS

Fondé en 1985, le groupe de sociétés Institutional Shareholder Services (« ISS ») donne aux investisseurs et aux entreprises les moyens de consolider une croissance durable et à long terme en fournissant des données, des analyses et des informations d'excellente qualité. Avec près de 2 000 employés répartis sur 30 sites aux États-Unis et ailleurs dans le monde, ISS est aujourd'hui le premier fournisseur mondial de solutions de gouvernance d'entreprise et d'investissement responsable, de services de fonds et de veille des marchés, ainsi que d'événements et de contenus éditoriaux destinés aux investisseurs institutionnels et aux entreprises du monde entier.

La Société de gestion a mis au point des outils de suivi intégrant la notation de solutions en matière d'impact durable, le « score ODD global » fourni par ISS-Oekom dans le cadre de son Évaluation des solutions de développement durable. Ces scores mesurent les impacts positifs et négatifs des produits et services d'une entreprise sur différentes solutions de développement durable. Elle adopte une approche thématique qui englobe 15 objectifs de durabilité distincts, en utilisant les Objectifs de Développement Durable (ODD) des Nations Unies (ONU) comme cadre de référence. Le score ODD global de solutions s'inscrit sur une échelle de -10,0 à +10,0, avec une classification sous-jacente selon les cinq grandes catégories d'évaluation suivantes :



Plus le score est élevé, plus l'impact est élevé ; un score négatif implique un impact négatif. Le score d'impact net intègre les scores d'impact négatif et positif. Le score d'impact net peut être neutre. Les compartiments dont l'objectif est de contribuer à un impact positif au regard des objectifs de développement durable de l'ONU devraient également tenir compte de l'impact négatif au regard des principes DNSH et PAI.

La liste des fournisseurs de données ESG utilisés par la Société de gestion peut évoluer à l'avenir, car davantage de données ESG seraient requises par la réglementation. La méthodologie peut également évoluer afin de couvrir d'autres enjeux ESG. Les dernières évolutions sont disponibles dans la Politique d'investissement durable publiée sur le site Internet de la Société de gestion. Veuillez noter que les gestionnaires de portefeuille délégués peuvent utiliser d'autres sources et méthodologies.

AEMF :

Autorité européenne des marchés financiers

AEMF/2012/197 :

Orientations émises par l'AEMF le 23 mars 2012 à l'intention des autorités compétentes et des sociétés de gestion d'OPCVM portant sur l'évaluation des risques et le calcul de l'exposition globale quant à certains types d'OPCVM structurés. Ce document est disponible sur le site Internet de l'AEMF (www.esma.europa.eu).

Gestionnaire d'investissement externe :

Gestionnaire d'investissement ne faisant pas partie de l'ABN AMRO Group

FATCA :

Loi américaine de 2010 sur l'imposition des comptes étrangers (Foreign Account Tax Compliance Act), telle que transposée au Luxembourg et basée sur l'Accord intergouvernemental entre le Luxembourg et les États-Unis, ratifié par le Parlement du Luxembourg le 24 juillet 2015.

IFD :

Instrument financier dérivé (y compris les dérivés négociés de gré à gré)

EFE :

Établissement financier étranger

FoM :

Fonds sous mandat

GDR

Certificats internationaux de dépôts (Global Depository Receipt)

Assemblée générale :

Assemblée générale des actionnaires

NIIM :

Numéro d'identification d'intermédiaire mondial

Haut rendement :

Ces investissements en obligations correspondent aux notations attribuées par les agences de notation aux emprunteurs, comprises entre BB+ et D selon l'échelle de notation de Standard & Poor's ou Fitch et Ba1 et I selon l'échelle de notation de Moody. Ces émissions d'obligations à haut rendement sont généralement des prêts émis sous forme d'obligations assorties d'échéances à 5, 7 ou 10 ans. Ces obligations sont émises par des sociétés dont la situation financière est fragile. Le rendement de ces titres ainsi que leur niveau de risque sont significatifs, ce qui les rend hautement spéculatifs

HKEX :

Hong Kong Exchanges and Clearing Limited

HKSCC :

Hong Kong Securities Clearing Company Limited, une filiale de HKEX détenue à 100 %

Bonne gouvernance :

Le SFDR traite clairement le principe de bonne gouvernance. La Société de gestion applique ce principe sous différents angles afin de s'assurer que le produit d'investissement respecte les bonnes pratiques de gouvernance : le processus de sélection des investissements du fonds est robuste, transparent et contraignant. Le fonds investit dans des sociétés dont les pratiques de gouvernance n'enfreignent pas les normes internationales/locales.

Plus précisément, la bonne gouvernance fait référence à des structures de gestion saines, aux relations avec les employés, à la rémunération du personnel et à la conformité fiscale.

Impact :

Les compartiments utilisant le mot « impact » dans leur dénomination sont considérés comme relevant de l'article 9 du SFDR et comme appliquant la politique d'investissement durable de la Société de gestion. Certains produits d'investissement peuvent relever de l'article 9 sans utiliser cette terminologie dans leur dénomination (par exemple, les fonds thématiques).

Commission indirecte :

Frais courants générés par les OPCVM sous-jacents et/ou les OPC investis par la Société et inclus dans les Frais courants mentionnés le cas échéant dans le DICI du compartiment

Investisseurs institutionnels :

Entités juridiques qui détiennent leur propre compte ou détiennent un compte au nom d'autres personnes physiques eu égard à un plan d'épargne de groupe ou un plan ou OPC équivalents Les gestionnaires de portefeuille concernés par les mandats de gestion de portefeuilles individuels

| | |
|--|---|
| | discrétionnaires (« Gestionnaires ») n'appartiennent pas à cette catégorie. |
| <u>Investment Grade :</u> | Ces investissements en obligations correspondent aux notations attribuées par les agences de notation aux emprunteurs, comprises entre AAA et BBB- selon l'échelle de notation de Standard & Poor's ou Fitch et Aaa et Baa3 selon l'échelle de notation de Moody. |
| <u>Gestionnaire(s) d'investissement :</u> | Les gestionnaires d'investissement auxquels la Société de gestion a délégué certaines tâches au regard de la Société |
| <u>Swap sur taux d'intérêt :</u> | Contrat d'échange (swaps) sur taux d'intérêt |
| <u>DICI :</u> | Document d'information clé pour l'investisseur |
| <u>Loi :</u> | Loi luxembourgeoise du 17 décembre 2010 concernant les organismes de placement collectif, telle qu'amendée |
| <u>Loi du 10 août 1915 :</u> | Loi luxembourgeoise du 10 août 1915 sur les sociétés commerciales, telle qu'amendée |
| <u>ManCo :</u> | Société de gestion |
| <u>Commission de gestion :</u> | Commission calculée et déduite quotidiennement de la valeur moyenne des actifs nets d'un compartiment, d'une catégorie ou sous-catégorie d'actions, versée à la Société de gestion et servant à couvrir la rémunération des gestionnaires d'actifs et également des distributeurs eu égard à la commercialisation des actions de la Société |
| <u>Gestionnaires :</u> | Gestionnaires des portefeuilles qui entrent dans la portée de la définition des mandats de gestion de portefeuilles individuels discrétionnaires |
| <u>Capitalisation boursière :</u> | <u>Société de petite capitalisation :</u> Société dont la capitalisation boursière est inférieure à 2 milliards EUR <u>Société de moyenne capitalisation :</u> Société dont la capitalisation boursière est située entre 2 et 7 milliards EUR <u>Société de grande capitalisation :</u> Société dont la capitalisation boursière est supérieure à 7 milliards EUR Les seuils de capitalisation boursière ci-dessus sont fournis à titre indicatif, étant donné qu'ils sont soumis aux mouvements de marché et peuvent connaître des fluctuations, comme déterminé de temps à autre par la Société de gestion (sans aucun préavis) |
| <u>Market timing :</u> | Technique d'arbitrage qui consiste pour l'investisseur à souscrire, racheter ou convertir des parts ou actions dans un même OPCVM sur une courte période en tirant parti des écarts temporaires et/ou des imperfections ou déficiences du système de détermination de la VNI des OPCVM Le recours à cette technique n'est pas autorisé par la Société |
| <u>Instruments du marché monétaire :</u> | Instruments normalement négociés sur le marché monétaire, qui sont liquides et dont la valeur peut être déterminée précisément à tout moment |
| <u>Fonds du marché monétaire :</u> | Fonds du marché monétaire conformes avec les orientations de l'AEMF (CESR/10-049 du 19 mai 2010) |
| <u>Commission Nationale de l'Informatique et des Libertés :</u> | Autorité indépendante créée en vertu de la loi du 2 août 2002 relative à la protection des personnes à l'égard du traitement des données à caractère personnel |
| <u>VNI :</u> | Valeur nette d'inventaire |
| <u>Canal nord :</u> | Canal par l'intermédiaire duquel les investisseurs de Hong Kong et étrangers négocient des Titres SSE ou SZSE |
| <u>OCDE :</u> | Organisation de coopération et de développement économiques |
| <u>Charges ponctuelles :</u> | Charges autres que celles de gestion, performance et autres commissions supportées par chaque compartiment et décrites ci-après. Ces charges incluent, entre autres, les charges juridiques et fiscales ainsi que les frais de conseil et frais divers facturés aux compartiments et non considérés comme des charges ordinaires |
| <u>De gré à gré :</u> | Contrats négociés de gré à gré |
| <u>Autres commissions :</u> | Commissions calculées et déduites quotidiennement de la valeur moyenne des actifs nets d'un compartiment, d'une catégorie ou sous-catégorie d'actions servant à couvrir les frais généraux de dépôt des actifs (rémunération du Dépositaire), les jetons de présence des administrateurs et les frais d'administration quotidiens (calcul de la VNI, enregistrement et maintien des comptes, les avis envoyés aux actionnaires, la fourniture et l'impression des documents légaux à remettre obligatoirement aux actionnaires et aux autorités réglementaires du Luxembourg, les frais liés à l'enregistrement de la Société auprès d'une autorité locale étrangère et à la maintenance de cet enregistrement, les frais de traduction du prospectus, des DICI et de tous autres documents légaux requis, les frais de préparation des DICI, les frais liés à l'établissement des fiches de synthèse et autres supports de commercialisation, les frais d'admission à la côte, les frais de domiciliation, les honoraires et les commissions des commissaires aux comptes, etc.), à l'exception des commissions de courtage, des frais de transactions autres que ceux liés au dépôt, des intérêts et frais bancaires, des charges ponctuelles et de la Taxe d'abonnement en vigueur au Luxembourg, ainsi que de toute autre taxe étrangère spécifique |
| <u>PAI :</u> | Le SFDR définit les principales incidences négatives (en anglais, « Principal Adverse Impacts » ou « PAI ») en matière de durabilité comme des effets négatifs, importants ou susceptibles d'être importants, sur les facteurs de développement durable qui sont causés, aggravés ou directement liés aux décisions d'investissement prises par la Société de gestion. À ce stade, elles s'entendent comme l'ensemble des politiques et engagements durables soutenus par la Société de gestion. À l'avenir, elles seront analysées au niveau du portefeuille (compartiment) |
| <u>Fonds(s) passif(s) :</u> | Véhicule(s) d'investissement qui suit / suivent le marché boursier, un indice boursier ou un domaine particulier du marché |
| <u>RPC :</u> | La République populaire de Chine |
| <u>Prospectus :</u> | Le présent document (comprenant les Livres I et II) |
| <u>Fonds(s) quantitatif(s) :</u> | Véhicule(s) d'investissement qui a(ont) recours à des techniques quantitatives de gestion d'investissements plutôt qu'une analyse humaine fondamentale |
| <u>Investissements immobiliers :</u> | Investissements en certificats de biens immobiliers, actions de sociétés liées à l'immobilier, OPCVM/OPC axés sur le thème de l'immobilier, organismes de placement collectif à capital fixe ou variable en biens immobiliers, produits de sociétés d'investissement immobilier (« Real Estate Investment Trusts » ou REIT) (et de sociétés ayant un statut équivalent dans la loi locale, SICAFI en Belgique, SIIC en France, etc.), instruments financiers dérivés basés sur des biens immobiliers, |

fonds négociés en bourse (« Exchange traded fund ou « ETF ») liés à des indices de biens immobiliers

Devise de référence :

Devise principale lorsqu'une même catégorie d'actions dispose de plusieurs devises de valorisation

Sensibilité :

Indicateur, exprimé en pourcentage, utilisé pour mesurer l'augmentation ou la diminution du prix d'une obligation ou de la valeur nette d'inventaire d'un fonds obligataire, causée par les fluctuations des taux d'intérêt du marché. La sensibilité dépend du niveau du taux et de la durée des titres

SEHK :

The Stock Exchange of Hong Kong Limited, une filiale de HKEX détenue à 100 %

SFDR :

Règlement (UE) 2019/2088 du Parlement européen et du Conseil, du 27 novembre 2019, sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (en anglais, « Sustainable Finance Disclosure Regulation » ou « SFDR »). L'objectif du SFDR est d'assurer une plus grande transparence en matière de durabilité sur les marchés financiers en procédant de manière normalisée, empêchant ainsi le « greenwashing » et assurant la comparabilité.

Ce règlement classe les produits d'investissement en trois groupes :

Produits d'investissement durable – article 9 : le produit d'investissement contribue aux objectifs E/S (avec des objectifs mesurables). L'objectif du fonds consiste à générer un impact positif dans les domaines environnementaux et/ou sociaux, à ne pas causer de préjudice important aux objectifs E/S et à prendre en compte la bonne gouvernance • Le niveau d'engagement en faveur du développement durable est solide et conforme à la Politique d'investissement durable de la Société de gestion.

Produits ESG – article 8 : le produit d'investissement encourage les caractéristiques E/S. L'objectif du fonds est de respecter des caractéristiques environnementales et/ou sociales et des objectifs financiers, en tenant compte de la bonne gouvernance • Le niveau d'engagement en faveur du développement durable est fort et conforme à la Politique d'investissement durable de la Société de gestion.

Autres produits – article 6 (produits qui ne correspondent pas à ces qualifications) : les caractéristiques E/S ne guident pas ou ne font pas partie du processus d'investissement • Le niveau d'engagement en faveur de la durabilité est faible. Tous les produits doivent appliquer l'ensemble des garanties E/S de base de la Société de gestion et déclarer si et comment les risques de durabilité sont intégrés dans les décisions d'investissement.

SICAFI :

« Société d'investissement à capital fixe », véhicule d'investissement immobilier à capital fixe soumis à la loi belge

Durable (« Sustainable ») :

Les compartiments utilisant le mot « Sustainable » (« durable » ou « durabilité ») dans leur dénomination sont considérés comme relevant de l'article 8 du SFDR et comme appliquant la Politique d'investissement durable de la Société de gestion. Certains produits d'investissement peuvent relever de l'article 8 du SFDR sans utiliser cette terminologie dans leur dénomination (par exemple, les fonds thématiques)

Facteurs de durabilité :

Terme collectif pour les questions environnementales et sociales, les relations avec les employés, le respect des droits de l'homme ou encore la lutte contre la corruption et les pots-de-vin

Risques de durabilité :

Le SFDR définit les risques de durabilité comme des événements ou des conditions environnementaux, sociaux ou de gouvernance qui, s'ils se concrétisent, pourraient avoir un impact négatif important sur la valeur financière du produit d'investissement

Afin de mesurer les Risques de durabilité de ses portefeuilles, la Société de gestion utilise la notation du risque ESG de Sustainalytics pour effectuer des analyses de portefeuille. La Société de gestion considère également que les principaux Risques de durabilité sont évités ou minimisés dans la mesure où les compartiments doivent se conformer à sa ou ses liste(s) d'exclusion(s)

SSE :

La Shanghai Stock Exchange (Bourse de Shanghai)

Système de traitement direct :

Traitement des transactions effectué électroniquement sans besoin d'autre manipulation ou d'intervention manuelle

Ajustement de la VNI (Swing Pricing) :

Tel que défini dans le Livre I, Section « Valeur nette d'inventaire », « Swing Pricing »

Facteur de Swing :

Tel que défini dans le Livre I, Section « Valeur nette d'inventaire », « Swing Pricing »

Seuil de Swing Pricing :

Tel que défini dans le Livre I, Section « Valeur nette d'inventaire », « Swing Pricing »

Écart de suivi :

L'écart de suivi ou le risque actif est une mesure du risque d'un portefeuille d'investissement qui résulte des décisions de gestion active prises par un gestionnaire de portefeuille. Il indique dans quelle mesure un portefeuille suit étroitement l'Indice de référence auquel il est comparé. L'écart de suivi résulte de la différence entre le rendement d'un gestionnaire et celui de son Indice de référence et se calcule comme l'écart type des différences entre le rendement du gestionnaire et celui de son Indice de référence sur différentes périodes. Le portefeuille d'un compartiment peut correspondre de manière significative à la performance et à la composition d'un Indice de référence. Toutefois, il n'y a aucune garantie qu'il atteindra ou cherchera à obtenir une parfaite correspondance de la performance et le compartiment peut potentiellement faire l'objet d'un écart de suivi. Par conséquent, les rendements peuvent ne pas correspondre exactement à ceux de l'Indice de référence respectif. Cet écart de suivi peut résulter de l'engagement de frais et dépenses opérationnels au titre du compartiment. L'écart de suivi peut également résulter de restrictions réglementaires ou de marché limitant les investissements dans certains types d'actifs, affectant ainsi les proportions du portefeuille par rapport à l'Indice de référence

Taxonomie :

Règlement (UE) 2020/852 du Parlement européen et du Conseil du 18 juin 2020 sur l'établissement d'un cadre visant à favoriser les investissements durables et modifiant le règlement (UE) 2019/2088. La Taxonomie de l'UE se compose d'une liste d'activités économiques considérées comme durables d'un point de vue environnemental à des fins d'investissement. La Taxonomie identifie ces activités selon des critères de performance pour leur contribution à six grands objectifs environnementaux : atténuation des changements climatiques, adaptation aux changements climatiques, utilisation durable et protection de l'eau et des ressources marines, transition vers l'économie circulaire (déchets, prévention et recyclage), prévention et contrôle de la pollution et protection des écosystèmes sains

L'objectif de la réglementation européenne est d'établir dans quelle mesure un investissement est durable d'un point de vue environnemental lorsqu'il respecte des objectifs environnementaux et de s'assurer qu'un produit d'investissement durable ne nuit pas de façon significative à ces objectifs et à d'autres objectifs durables

| | |
|---|---|
| <u>OPC :</u> | Organisme de placement collectif |
| <u>OPCVM :</u> | Organisme de placement collectif en valeurs mobilières |
| <u>Principes du Pacte mondial des Nations Unies :</u> | Les principes du Pacte mondial pour les entreprises soutenus par les Nations Unies, tel qu'indiqué sur le site Internet du Pacte mondial des Nations Unies (https://www.unglobalcompact.org/what-is-gc/mission/principles). <u>S'articulant autour de 10 principes, le Pacte mondial des Nations Unies établit des normes internationales pour les sociétés eu égard aux meilleures pratiques dans le domaine des Droits de l'Homme, du travail, de l'environnement et de la lutte contre la corruption.</u> Les compartiments conformes aux Principes du Pacte mondial des Nations Unies y font expressément référence dans leur politique d'investissement et ont alors l'obligation de les respecter. Une société non conforme à ces principes sera réputée être particulièrement controversée et exclue du portefeuille du compartiment |
| <u>Principes pour l'investissement responsable des Nations Unies :</u> | Les Principes pour l'investissement responsable soutenus par les Nations Unies, tel que décrit sur le site Internet des Principes pour l'investissement responsable des Nations Unies (https://www.unpri.org/pri/an-introduction-to-responsible-investment/what-are-the-principles-for-responsible-investment). Ces principes, au nombre de six, servent de normes internationales en termes d'investissement responsable selon les facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance. Les compartiments conformes aux Principes d'investissement responsable des Nations Unies y font expressément référence dans leur politique d'investissement et ont alors l'obligation de les respecter |
| <u>Ressortissant américain :</u> | Personne définie par la réglementation S de la SEC aux États-Unis (Part 230 – 17 CFR 230.903) ou toute autre personne ou entité détenant des actions ou qui, si elle devait en détenir, entraînerait des circonstances (influençant directement ou indirectement ladite personne ou entité, et subies seules ou conjointement avec d'autres personnes ou entités, intéressées ou non, ou toutes autres circonstances) qui, de l'avis du conseil d'administration de la Société, pourraient entraîner pour la Société un assujettissement fiscal aux États-Unis ou tout autre préjudice pécuniaire, juridique ou administratif que la Société n'aurait peut-être pas rencontré ou subi hors desdites circonstances |
| <u>Devise(s) de valorisation :</u> | Devise dans laquelle est calculée la VNI d'un compartiment, d'une catégorie ou sous-catégorie d'actions Il se peut que le même compartiment ou la même catégorie ou sous-catégorie d'actions dispose de plusieurs devises de valorisation (dénommé organisme multi-devises). Lorsque la devise de libellé de la catégorie ou de la sous-catégorie d'actions est différente de la devise de comptabilité, les ordres de souscription/conversion/rachat peuvent être pris en compte sans être soumis à des commissions de change |
| <u>Jour de valorisation :</u> | Chaque jour d'ouverture des banques au Luxembourg et sous réserve des exceptions indiquées dans le Livre II. Il correspond également : <ul style="list-style-type: none"> - à la date effective de la VNI lors de sa publication ; - au jour de négociation des ordres de transaction ; - en ce qui concerne les exceptions aux règles de valorisation, au jour de clôture des cours utilisés dans la méthode de valorisation des actifs sous-jacents des portefeuilles des compartiments. |
| <u>VaR :</u> | Valeur en risque, méthode spécifique d'évaluation du risque d'un compartiment (voir Annexe 2) |

ABN AMRO Funds

Sous son nom abrégé ou AAF

LIVRE I DU PROSPECTUS

DISPOSITIONS D'ORDRE GENERAL

ABN AMRO Funds est une société d'investissement à capital variable, SICAV, constituée en vertu des lois du Luxembourg le 17 novembre 2000 pour une période indéterminée sous le nom « A.A. ADVISORS Multi-Manager Funds », conformément aux dispositions de la Partie II de la Loi du Luxembourg du 30 mars 1988 régissant les organismes de placement collectif. Elle a été renommée « ABN AMRO Funds » à compter du 1^{er} juillet 2019 suite à l'Assemblée générale extraordinaire du 31 mai 2019.

Le nom complet « ABN AMRO Funds » ou le nom abrégé « AAF » peuvent être également utilisés dans les documents officiels et commerciaux de la Société.

La Société est actuellement régie par les dispositions de la Partie I de la Loi du 17 décembre 2010 régissant les organismes de placement collectif ainsi que par la Directive 2009/65.

Le capital de la Société est exprimé en euros (« **EUR** ») et correspond à tout moment aux actifs nets des différents compartiments. Il est constitué d'actions entièrement libérées émises sans désignation de valeur nominale et nommées ci-après « **Actions** ». Le capital varie automatiquement sans notification et sans les mesures spécifiques requises pour l'augmentation ou la diminution de capital des sociétés à responsabilité limitée. Le capital minimum est défini par la Loi.

La Société est immatriculée au Registre de Commerce et des Sociétés de Luxembourg sous le numéro B 78 762.

La Société est un fonds à compartiments multiples, lesquels comprennent des actifs et passifs distincts de la Société. Chaque compartiment aura une politique d'investissement et une devise de référence spécifiques déterminées par le Conseil d'administration.

La Société est une entité juridique unique.

Conformément à l'Article 181 de la Loi :

- les droits des actionnaires et des créanciers relatifs à un compartiment, ou découlant de la création, du fonctionnement ou de la liquidation d'un compartiment sont limités aux actifs de ce compartiment ;
- les actifs d'un compartiment sont la propriété exclusive des actionnaires de ce compartiment et des créanciers lorsque la créance découle de la création, du fonctionnement ou de la liquidation du compartiment ;
- eu égard aux relations entre les actionnaires, chaque compartiment est traité comme une entité séparée.

Le Conseil d'administration peut, à tout moment, créer de nouveaux compartiments ainsi que de nouvelles politiques d'investissement ou procédures d'offre, auxquels cas ces informations seront communiquées en temps opportun dans une mise à jour du Prospectus. Si les réglementations l'exigent ou si le Conseil d'administration le juge approprié, les actionnaires seront également informés par des publications dans la presse. Le Conseil d'administration peut, de manière similaire, clôturer les compartiments conformément aux dispositions prévues à l'Annexe 5.

ADMINISTRATION ET GESTION

La Société est dirigée et représentée par le Conseil d'administration, lequel agit sous l'autorité de l'Assemblée générale. La Société a recours à des services externes de gestion, d'audit et de dépôt d'actifs. Les rôles et responsabilités correspondants à ces fonctions sont décrits ci-après. La composition du Conseil d'administration, les noms et adresses des fournisseurs de services ainsi que des informations détaillées y relatives sont indiqués ci-dessus dans la section « Informations d'ordre général ».

La Société de gestion, les Gestionnaires d'investissement, le Dépositaire, l'Agent administratif, les distributeurs et autres fournisseurs de services ainsi que leurs associés, cadres dirigeants, administrateurs et actionnaires respectifs (les « **Parties** ») participent ou peuvent prendre part à d'autres activités financières, d'investissement ou professionnelles susceptibles de donner lieu à des conflits d'intérêts avec l'équipe dirigeante et de gestion de la Société. Ces activités incluent la gestion d'autres fonds, les achats et ventes de titres, les services de courtage, de dépositaire et de conservation ainsi que les mandats d'administrateurs, cadres dirigeants, conseillers ou représentants d'autres fonds ou sociétés, y compris des sociétés dans lesquelles un compartiment est susceptible d'investir. Chacune des Parties s'assurera que l'exécution de ses tâches respectives ne sera pas affectée par son implication dans d'autres activités. Si un conflit d'intérêts survient, les Administrateurs et les Parties impliquées s'efforceront de veiller à ce qu'il soit réglé équitablement, en temps voulu et dans l'intérêt de la Société.

Conseil d'administration

Le Conseil d'administration est responsable en dernier ressort de la gestion de la Société et est par conséquent responsable de la définition et de la mise en œuvre de la politique d'investissement de la Société.

Le Conseil a confié à M. François-Xavier GENNETAIS (Directeur général) les responsabilités concernant la gestion quotidienne de la Société (y compris le droit d'agir en tant que signataire autorisé de la Société) et sa représentation.

Société de gestion

ABN AMRO Investment Solutions est une société anonyme constituée en vertu du droit français le 18 décembre 1998 et appartenant à l'ABN AMRO Group.

La Société de gestion exerce les fonctions d'administration, de gestion de portefeuille et de commercialisation pour le compte de la Société.

La Société de gestion est autorisée à déléguer une partie ou la totalité de ces fonctions, sous sa responsabilité et à ses frais, à des tiers de son choix.

Elle a utilisé ce pouvoir pour déléguer :

- les fonctions de calcul de la VNI, d'agent de transfert et de registre à STATE STREET BANK INTERNATIONAL GMBH, SUCCURSALE LUXEMBOURGEOISE (l'« **Agent de registre** ») ;
- la gestion des avoirs de la Société et le respect de ses politiques et restrictions d'investissement aux gestionnaires d'investissement mentionnés ci-dessus dans la section « Informations d'ordre général ». Une liste des gestionnaires d'investissement effectivement chargés de la gestion et les détails relatifs aux portefeuilles gérés sont annexés aux rapports périodiques de la Société. Les investisseurs peuvent demander à la Société de gestion, gratuitement, une liste actualisée des gestionnaires d'investissement spécifiant les portefeuilles gérés par chacun d'entre eux.

La Société de gestion et tout gestionnaire d'investissement exécuteront les transactions de titres et sélectionneront les courtiers, négociants ou autres contreparties après avoir préalablement vérifié et retenu les meilleures conditions générales offertes. Pour toute transaction, cela impliquera de prendre en considération tous les facteurs jugés pertinents, tels que l'ampleur du marché, le cours du titre ainsi que la situation financière et la capacité d'exécution de la contrepartie. Un Gestionnaire d'investissement peut sélectionner des contreparties au sein de ABN AMRO Group dans la mesure où celles-ci semblent offrir les meilleures conditions générales.

Par ailleurs, la Société de gestion peut décider de désigner des distributeurs/délégateurs pour contribuer à la distribution des actions de la Société dans les pays où elles sont commercialisées.

Les contrats de distribution et de délégation seront conclus entre la Société de gestion et les différents distributeurs/délégateurs.

Conformément au contrat de distribution et de délégation, le délégataire sera inscrit dans le registre des actionnaires en place.

Les actionnaires ayant investi dans la Société par l'intermédiaire d'un délégataire peuvent demander à tout moment le transfert en leur nom des actions souscrites par le biais du délégataire. Dans ce cas, les actionnaires seront inscrits sous leur propre nom dès que les instructions de transfert envoyées par le délégataire auront été reçues.

Les investisseurs peuvent souscrire des actions directement auprès de la Société sans faire appel à un distributeur/délégateur.

La Société attire l'attention des investisseurs sur le fait que tout investisseur aura uniquement la possibilité d'exercer pleinement ses droits envers elle, notamment le droit de participer aux assemblées générales des actionnaires s'il est lui-même enregistré en son nom propre auprès du registre des actionnaires de la Société. Dans les cas où l'investisseur investit dans la Société à travers un intermédiaire et que celui-ci opère en son nom propre, mais pour le compte de l'investisseur, il se peut que ce dernier ne soit pas toujours en mesure d'exercer certains des droits d'actionnaires directement envers la Société. Il est recommandé aux investisseurs de prendre conseil au sujet de leurs droits.

Rémunération

La politique de rémunération de la Société de gestion est cohérente avec et favorise une gestion de risque solide et efficace et n'encourage pas une prise de risque incompatible avec le profil de risque, les règles et les statuts des compartiments gérés.

La politique de rémunération reflète les objectifs de la Société de gestion visant à garantir une bonne gouvernance d'entreprise ainsi que la création de valeur à long terme durable pour les actionnaires. La politique de rémunération a été conçue et mise en œuvre afin :

- contribuer activement à la réalisation des objectifs et de la stratégie de la Société de gestion ;
- contribuer au niveau de compétitivité de la Société de gestion dans les marchés où elle exerce ses activités ;
- d'attirer, développer le potentiel et fidéliser des employés très compétents et motivés.

Les employés de la Société de gestion reçoivent une rémunération globale compétitive et alignée sur les rémunérations pratiquées dans le marché avec une composante fixe significative.

Les lignes directrices de la politique de rémunération sont passées en revue régulièrement et sont adaptées en fonction de l'évolution du cadre réglementaire. La politique de rémunération a été approuvée par le Conseil d'administration de la Société de gestion.

Une copie écrite de la politique de rémunération peut être obtenue gratuitement sur demande.

Des informations détaillées concernant la politique de rémunération actualisée, comprenant entre autres, la description du mode de calcul de la rémunération et des avantages ainsi que l'identité des personnes responsables d'accorder ces rétributions et avantages, y compris la composition du comité de rémunération, le cas échéant, seront disponibles sur le site Internet suivant, après approbation de ladite politique de rémunération par l'AMF : <https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/footer/regulatory-information.html>. Une copie écrite de la politique de rémunération peut être obtenue gratuitement sur demande.

Dépositaire

La Société a nommé State Street Bank International GmbH, agissant par l'intermédiaire de sa succursale luxembourgeoise, en tant que Dépositaire au sens de la Loi en vertu du Contrat de dépositaire. State Street Bank International GmbH est une société à responsabilité limitée établie en vertu des lois allemandes, dont le siège social est sis Brienner Str. 59, 80333 Munich, Allemagne et enregistrée au registre commercial du tribunal de Munich sous le numéro HRB 42872. Elle agit en tant qu'établissement de crédit sous le contrôle de la Banque centrale européenne, de l'Autorité de surveillance allemande des services financiers (« BaFin ») et de la Banque centrale allemande. State Street Bank International GmbH, Succursale luxembourgeoise est agréée par la CSSF au Luxembourg afin d'agir en tant que dépositaire et se spécialise dans les services de dépôt, d'administration de fonds et connexes. State Street Bank International GmbH, Succursale luxembourgeoise est enregistrée au Registre de Commerce et des Sociétés de Luxembourg (« RCS ») sous le numéro B 148 186. State Street Bank International GmbH est membre du groupe d'entreprises State Street, dont la société mère ultime est State Street Corporation, une société américaine cotée en Bourse.

Fonctions du Dépositaire

La relation entre la Société et le Dépositaire est régie en vertu des conditions du Contrat de dépositaire. En vertu des conditions du Contrat de dépositaire, le Dépositaire doit :

- garantir que la vente, l'émission, le rachat, le remboursement et l'annulation des actions/parts sont exécutés conformément aux dispositions de la loi applicable et aux réglementations en matière de gestion/Statuts ;
- s'assurer que la valeur des actions/parts est calculée conformément à la loi applicable et aux réglementations en matière de gestion/Statuts ;
- suivre les instructions de la Société de gestion/la Société, à moins que celles-ci soient contraires à la loi applicable et aux réglementations en matière de gestion/Statuts ;
- garantir que pour les transactions sur des actifs de la Société, toute contrepartie est remise dans les délais usuels ;
- s'assurer que le revenu de l'OPCVM est alloué conformément à la loi applicable et aux réglementations en matière de gestion/Statuts ;
- effectuer le suivi continu des avoirs liquides et équivalents de la Société ;
- conserver les actifs de la Société, notamment les instruments financiers devant être mis en dépôt et dont les titres de propriété doivent être vérifiés, et maintenir des registres eu égard aux autres actifs.

Responsabilités du Dépositaire

En cas de perte de tout instrument financier mis en dépôt, déterminée conformément à la Directive 2009/65, et en particulier à l'Article 18 de la Loi, le Dépositaire, agissant pour le compte de la Société, sera tenu de restituer sans retard indu un instrument financier de type identique ou le montant correspondant à la Société/Société de gestion.

Le Dépositaire ne saurait être tenu responsable s'il peut prouver que la perte de l'instrument financier mis en dépôt a résulté d'un événement externe raisonnablement indépendant de sa volonté, et dont les conséquences auraient été inévitables en dépit de tous efforts conjugués pour obtenir l'effet contraire en vertu de la Directive 2009/65.

En cas de perte des instruments financiers mis en dépôt, les actionnaires peuvent invoquer la responsabilité du Dépositaire directement ou indirectement par l'intermédiaire de la Société, sous réserve que cela ne puisse induire des mesures de redressement cumulées ou un traitement inéquitable des actionnaires.

Le Dépositaire sera responsable envers la Société de toutes les autres pertes que cette dernière aura subies en raison de sa négligence ou de la mauvaise exécution intentionnelle de ses obligations, conformément à la Directive 2009/65.

Le Dépositaire ne saurait être tenu responsable des pertes ou dommages consécutifs ou indirects ou spéciaux, nés ou liés à l'exécution ou non-exécution par le Dépositaire de ses fonctions et obligations.

Délégation

Le Dépositaire a tout pouvoir de déléguer tout ou partie de ses fonctions de conservation, mais sa responsabilité ne se trouvera en rien affectée par le fait qu'il a confié à un tiers tout ou partie des actifs placés sous sa garde. La responsabilité du Dépositaire ne saurait être affectée par le fait qu'il ait délégué ses fonctions de conservation des actifs dans le cadre d'un Contrat de Dépositaire.

Le Dépositaire a délégué ses obligations de conservation des actifs définies dans l'article 22(5)(a) de la Directive 2009/65 à State Street Bank and Trust Company qu'il a nommée en tant que sous-dépositaire mondial et dont le siège social se situe à One Congress Street, Suite 1, Boston, Massachusetts 02114, États-Unis. State Street Bank and Trust Company a nommé, en tant que sous-dépositaire mondial, des sous-dépositaires locaux appartenant au State Street Global Custody Network (réseau de sociétés de conservation d'actifs de State Street).

Les informations relatives aux fonctions de conservation qui ont été déléguées et l'identification des délégués et sous-délégués concernés sont disponibles auprès du siège social du Dépositaire et via le lien suivant : www.statestreet.com/about/office-locations/luxembourg/subcustodians.html.

Conflits d'intérêts

Le Dépositaire fait partie d'un groupe international de sociétés qui, dans le cadre de leurs activités normales, agissent simultanément pour le compte d'un grand nombre de clients ainsi que pour leur propre compte, ce qui peut induire des conflits d'intérêts réels ou potentiels. Les situations de conflits d'intérêts surviennent lorsque le Dépositaire ou ses sociétés affiliées exercent des activités en vertu d'un Contrat de dépositaire ou en vertu de contrats séparés ou d'autres accords. Ces activités peuvent inclure :

- (i) procuration de délégataire, administration, agence de registre et de transfert, recherche, gestion d'investissement, conseil financier et/ou autres services de conseil à la Société ;

(ii) souscription des transactions bancaires et d'achat et de vente d'actifs, y compris des transactions de change ou sur instruments dérivés, des opérations de courtage, de tenue de marché ou d'autres transactions financières avec la Société en tant qu'acteur principal et pour ses propres intérêts ou pour les intérêts d'autres clients.

Concernant les activités susmentionnées, le Dépositaire ou ses sociétés affiliées :

(i) chercheront à dégager un profit de ces activités et seront habilités à recevoir et conserver tout profit ou toute contrepartie sous quelque forme que ce soit sans être contraints de divulguer à la Société, la nature ou le montant de ce profit ou cette rémunération, incluant les honoraires, charges, commissions, parts de revenus, écarts de prix (spreads), majorations, minorations, intérêts, rabais, remises ou autres avantages reçus liés à de telles activités ;

(ii) peuvent acheter, vendre, émettre, négocier ou détenir des titres ou autres produits ou instruments financiers en tant qu'entité principale agissant pour ses propres intérêts, ou pour les intérêts de ses sociétés affiliées ou d'autres clients ;

(iii) peuvent négocier des opérations allant dans le même sens ou dans le sens contraire aux transactions souscrites, y compris celles basées sur des informations en sa possession dont la Société n'a pas connaissance ;

(iv) peuvent fournir des services identiques ou similaires à d'autres clients, y compris des concurrents de la Société ;

(v) peuvent obtenir de la part de la Société des droits de créancier qu'il est susceptible d'exercer.

La Société peut faire appel à une société affiliée du Dépositaire pour exécuter des transactions de change au comptant ou des swaps de devises pour le compte de la Société. Dans ces cas précis, la société affiliée agira en tant que principal et non en tant que courtier, agent ou fiduciaire de la Société. La société affiliée cherchera à dégager des profits sur ces transactions et sera habilitée à les conserver sans en faire part à la Société.

La Société conclura toutes ces transactions selon les conditions et modalités convenues avec la Société.

Lorsque des avoirs liquides de la Société sont déposés auprès d'une société affiliée ayant le statut de banque, un conflit d'intérêts potentiel se crée en relation avec les intérêts (le cas échéant) que la société affiliée est susceptible de payer ou de facturer sur ledit compte de dépôt et avec les commissions ou autres rémunérations qu'elle est susceptible de recevoir en contrepartie de son service de dépôt des avoirs en tant que banque et non en tant que fiduciaire. La Société de Gestion peut également être un client ou une contrepartie du Dépositaire ou de ses sociétés affiliées.

Les conflits potentiels pouvant survenir lorsque le Dépositaire fait appel à des sous-dépositaires sont regroupés en quatre grandes catégories :

(i) ceux provenant de la sélection et de l'allocation d'actifs effectuées par un sous-dépositaire, parmi de multiples sous-dépositaires influencés par (a) des facteurs de coûts, notamment les commissions les plus faibles, les remises sur commission ou rabais similaires et (b) de vastes relations commerciales bidirectionnelles dans lesquelles le Dépositaire peut agir en se basant sur la valeur économique de la relation la plus importante, en plus de critères d'évaluation objectifs ;

(ii) ceux survenant lorsque les sous-dépositaires, qu'il s'agisse de sociétés affiliées ou non affiliées, interviennent pour le compte d'autres clients et pour leur intérêt exclusif, pouvant de ce fait interférer avec les intérêts des clients ;

(iii) ceux survenant lorsque les sous-dépositaires, qu'il s'agisse de sociétés affiliées ou non affiliées n'ont que des relations indirectes avec leurs clients et considèrent le Dépositaire comme leur contrepartie, ce qui peut inciter le Dépositaire à agir en son propre intérêt ou dans les intérêts d'autres clients au détriment des clients ; et

(iv) ceux survenant lorsque les sous-dépositaires disposent éventuellement de droits de créanciers fondés sur les lois du marché envers les actifs des clients, qu'ils peuvent avoir intérêt à exercer pour obtenir les paiements non reçus relatifs à des transactions de titres.

Dans le cadre de l'exécution de ses tâches, le Dépositaire devra agir de manière honnête, équitable professionnelle et indépendante et dans les seuls intérêts de la Société et de ses actionnaires.

Le Dépositaire sépare l'exécution de ses tâches en tant que dépositaire des autres tâches pouvant créer un conflit d'intérêts de manière fonctionnelle et hiérarchique. Le système de contrôles internes, les différents ensembles d'informations à communiquer, l'attribution de tâches et le reporting de la gestion permettent d'identifier, gérer et contrôler adéquatement les conflits d'intérêts potentiels et les problèmes liés à la fonction de Dépositaire. Par ailleurs, lorsqu'il fait appel à des sous-dépositaires, le Dépositaire peut imposer des restrictions contractuelles de manière à résoudre certains des conflits d'intérêts potentiels et maintenir un contrôle et une surveillance de ces agents afin de garantir aux clients un service de qualité élevé. Le Dépositaire prépare en plus, des rapports d'information fréquents concernant les activités et avoirs de ses clients, avec des fonctions sous-jacentes soumises aux audits interne et externe. Enfin, le Dépositaire sépare en interne l'exécution de ses fonctions de conservation de celles de son activité propre et suit une norme de conduite exigeant des employés qu'ils agissent dans le respect des règles éthiques et de manière juste et transparente avec les clients.

Les actionnaires peuvent obtenir sur demande des informations mises à jour concernant le Dépositaire, ses missions et les conflits d'intérêts susceptibles de survenir, toute délégation de la fonction de conservation, la liste des délégués et des sous-délégués et tout conflit d'intérêts pouvant découler d'une telle délégation.

Commissaire aux comptes

Tous les comptes de la Société et toutes les transactions y relatives sont soumis à un audit annuel effectué par le Commissaire aux comptes.

POLITIQUE, OBJECTIFS, RESTRICTIONS ET TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

L'objectif général de la Société est de fournir aux investisseurs l'appréciation du capital investi la plus élevée possible tout en contemplant une large distribution des risques. À cette fin, la Société investira principalement ses actifs dans une gamme de valeurs mobilières, d'instruments du marché monétaire, de parts ou d'actions d'OPC, de dépôts d'établissements de crédit et dérivés libellés en différentes devises et émis dans différents pays.

Multi-gestion : ce concept permet de changer le gestionnaire d'investissement du compartiment sans notification préalable des actionnaires des compartiments.

La politique d'investissement de la Société est déterminée par le Conseil d'administration à la lumière de la situation politique, économique et monétaire. La politique variera pour les différents compartiments, dans les limites, et en conformité avec les caractéristiques spécifiques et l'objectif de chacun d'entre eux tels que stipulés dans le livre II du Prospectus.

La politique d'investissement sera conduite en adhérant strictement aux principes de diversification et répartition des risques. À cette fin, et sans préjudice de toute précision éventuelle concernant individuellement un ou plusieurs compartiments, la Société sera soumise à une série de restrictions d'investissement telles que stipulées à l'Annexe 1. À cet égard, nous attirons l'attention des investisseurs sur les risques décrits à l'Annexe 3.

Chaque compartiment appartient à une catégorie. La liste des catégories se présente de la façon suivante :

« Gestionnaire unique »

La Société de gestion peut gérer directement les compartiments ou déléguer leur gestion à un Gestionnaire d'investissement externe (lequel prendra des décisions d'investissement sur la partie du portefeuille qui lui est attribuée) qu'elle aura elle-même sélectionné conformément à des critères prédéfinis, notamment :

- une sélection qualitative (i) en analysant la stabilité et la force du Gestionnaire d'investissement externe, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique et, (ii) en rencontrant ses équipes ;
- une sélection quantitative visant à retenir uniquement les Gestionnaires d'investissement externes ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Les investisseurs peuvent obtenir une liste actualisée des gestionnaires d'investissement par délégation, sur demande, auprès du siège social de la Société.

Pour de plus amples informations sur les risques, veuillez vous référer à l'Annexe 3 ci-après.

« Fonds sous mandat » (ou « FoM », Fund of Mandates)

La Société de gestion peut déléguer une partie de la gestion des compartiments à un minimum de deux Gestionnaires d'investissement externes (lesquels prendront des décisions d'investissement sur la partie du portefeuille qui leur est attribuée) qu'elle aura elle-même sélectionnés conformément à des critères prédéfinis, notamment :

- une sélection qualitative (i) en analysant la stabilité et la force du Gestionnaire d'investissement externe, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique et, (ii) en rencontrant ses équipes ;
- une sélection quantitative visant à retenir uniquement les Gestionnaires d'investissement externes ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Les investisseurs peuvent obtenir une liste actualisée des gestionnaires d'investissement par délégation, sur demande, auprès du siège social de la Société.

Pour de plus amples informations sur les risques, veuillez vous référer à l'Annexe 3 ci-après.

« Profil »

La Société de gestion peut :

- a) déléguer une partie de la gestion des compartiments à un minimum de deux Gestionnaires d'investissement externes, lesquels prendront des décisions d'investissement sur la partie du portefeuille qui leur est attribuée.
- b) investir dans des parts ou actions de fonds d'investissement à capital variable ayant le statut d'OPCVM en vertu de la Directive 2009/65 et/ou d'autres organismes de placement collectif au sens de ladite Directive 2009/65.
- c) gérer directement les compartiments.

Les OPCVM et délégations sont sélectionnés conformément à des critères prédéfinis, notamment :

- une sélection qualitative (i) en analysant la stabilité et la force du Gestionnaire d'investissement externe, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique et, (ii) en rencontrant ses équipes ;
- une sélection quantitative visant à retenir uniquement les Gestionnaires d'investissement externes ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Les investisseurs peuvent obtenir une liste actualisée des gestionnaires d'investissement par délégation, sur demande, auprès du siège social de la Société.

Les compartiments peuvent investir dans des obligations, des actions et des instruments du marché monétaire à travers des investissements directs, des instruments financiers dérivés ainsi que des organismes de placement collectif (y compris des fonds négociés en bourse). L'accent est mis sur la diversification des investissements à l'échelle mondiale.

« Fonds de fonds »

Les compartiments investiront dans des parts ou actions de fonds d'investissement à capital variable ayant le statut d'OPCVM en vertu de la Directive 2009/65 et/ou d'autres organismes de placement collectif au sens de ladite Directive 2009/65 et sélectionnés conformément à des critères prédéfinis, notamment :

- une sélection qualitative (i) en analysant la stabilité et la force de la société de gestion des fonds de placement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'elle applique et, (ii) en rencontrant ses équipes ;
- une sélection quantitative visant à retenir uniquement les OPCVM et autres OPC ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Les compartiments peuvent également détenir des liquidités et avoirs équivalents à titre accessoire, y compris des certificats de dépôt et des dépôts à court terme.

« Autres fonds »

Ces compartiments qui ont un profil de risque et un style d'allocation d'actifs propre sont activement gérés en investissant dans des parts ou actions de fonds d'investissement à capital variable ayant le statut d'OPCVM en vertu de la Directive 2009/65 et/ou d'autres organismes de placement collectif au sens de ladite Directive 2009/65, des titres de capital négociables ou des titres de créance ou encore une combinaison de l'ensemble de tous ces instruments.

Les valeurs mobilières comprennent, entre autres, les actions, les parts et certificats de dépôts, les obligations convertibles, les indices d'actions et les bons de participation dans la mesure autorisée par la Loi. Les valeurs mobilières comprennent, entre autres, les titres à revenu fixe négociable, les titres adossés à des crédits hypothécaires, les instruments à coupon zéro, les obligations à taux variable, les contrats à taux d'intérêt plafonds (cap), planchers (floor) ou une combinaison des deux (collars) et d'autres types de créance, dont ceux assortis d'une échéance résiduelle moyenne relativement courte émis ou garantis par des gouvernements, des agences gouvernementales, des organisations supranationales et des grandes entreprises.

Ces compartiments peuvent à l'occasion investir dans des valeurs mobilières et des instruments de marché monétaire non cotés dans les limites posées à l'Annexe 1.

Les compartiments peuvent également détenir des liquidités et avoirs équivalents à titre accessoire, y compris des certificats de dépôt et des dépôts à court terme. Le Conseil d'administration a adopté une politique de gouvernance d'entreprise qui prévoit le droit de voter aux assemblées générales d'actionnaires des sociétés dans lesquelles investissent les compartiments. Les principes essentiels gouvernant la politique du Conseil en matière de vote reposent sur la capacité de la société à faire preuve de transparence et de responsabilité envers les actionnaires eu égard à leurs investissements et sur le fait qu'une société doit être gérée de manière à générer la croissance et le rendement des parts de capital sur le long terme. Le Conseil d'administration exécutera sa politique en matière de vote en agissant de bonne foi et dans le meilleur intérêt des actionnaires des fonds d'investissement. Pour plus de références, veuillez consulter le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Par ailleurs, la Société est autorisée à utiliser des techniques et instruments sur valeurs mobilières et des actifs du marché monétaire en vertu des conditions et limites définies à l'Annexe 2 sous réserve que ces techniques et instruments soient employés à des fins de gestion efficace de portefeuille, ou dans le but d'atteindre son objectif d'investissement et/ou à des fins de trésorerie et/ou en cas de conditions de marché défavorables. Lorsque ces opérations impliquent le recours aux dérivés, lesdites conditions et limites doivent respecter les dispositions prévues par la Loi. Ces opérations ne sauraient en aucune circonstance conduire la Société et ses compartiments à dévier de leurs objectifs d'investissement tels que décrits dans le Prospectus.

Finalement, afin de réduire les dépenses d'exploitation et administratives dans le cadre d'une diversification ample des investissements, le Conseil d'administration peut décider, conformément aux stipulations de l'Annexe 4, que certains ou la totalité des actifs de la Société soient cogérés avec des actifs appartenant à d'autres organismes de placement collectif ou que certains ou la totalité des actifs d'un compartiment soient cogérés avec des actifs appartenant à d'autres compartiments.

À moins qu'il n'en soit spécifié autrement dans la politique d'investissement de chaque compartiment, aucune garantie ne peut être donnée quant à la réalisation des objectifs d'investissement des compartiments, et les performances passées ne préjugent pas des performances futures.

LES ACTIONS

CATÉGORIES ET SOUS-CATÉGORIES D'ACTIONS

Au sein de chaque compartiment, le conseil d'administration aura la possibilité de créer les catégories et sous-catégories d'actions (« catégories » et « sous-catégories ») suivantes :

| <i>Catégorie⁽⁴⁾</i> | <i>Sous-catégorie</i> | <i>Enregistrement</i> | <i>Investisseurs</i> | <i>Prix de souscription initiale par Action⁽¹⁾</i> | <i>Participation minimale⁽²⁾</i> |
|---|--|-----------------------|--|---|---|
| Catégorie A | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | Tous | 100 EUR 100 USD 100 GBP 1 000 SEK | 100 EUR 100 USD 100 GBP 1 000 SEK |
| Catégorie AH EUR | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | | 100 EUR | 100 EUR |
| Catégorie AH USD | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | | 100 USD | 100 USD |
| ABN AMRO Wealth Allocation | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | | 100 EUR | 100 EUR |
| ABN AMRO Profifonds A ABN AMRO Profifonds B ABN AMRO Profifonds C | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 100 EUR | 100 EUR |
| Catégorie A2 | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | Investisseurs clients de Banque Neuflyze OBC ou de ses sociétés affiliées et investisseurs autorisés | 100 EUR | 100 EUR |
| Catégorie A3 | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | Investisseurs clients d'Aegon ou de ses sociétés affiliées et investisseurs autorisés | 100 EUR | 100 EUR |
| Catégorie A4 | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | Investisseurs clients d'Aegon et utilisant la catégorie d'actions pour des activités de conseil et de gestion de portefeuille discrétionnaire et investisseurs autorisés | 100 EUR | 100 EUR |
| Catégorie B | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 100 EUR | 5 000 EUR |
| Catégorie C | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | | 100 EUR 100 USD | 5 000 EUR 5 000 USD |
| Catégorie C2 | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | | 100 EUR 100 USD | 5 000 EUR 5 000 USD |
| Catégorie CH EUR | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | | 100 EUR | 5 000 EUR |
| Catégorie D | Capitalisation | Oui | Investisseurs clients | 100 EUR | 5 000 EUR |

| Catégorie⁽⁴⁾ | Sous-catégorie | Enregis-trement | Investisseurs | Prix de souscription initiale par Action⁽¹⁾ | Participation minimale⁽²⁾ |
|-----------------------------------|--|------------------------|--|---|---|
| Catégorie DH EUR | (CAP) Distribution (DIS) | | de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | | |
| Catégorie E | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de ABN AMRO et investisseurs autorisés | 100 EUR | 5 000 EUR |
| Catégorie F | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neulize OBC et investisseurs autorisés | 100 EUR | 5 000 EUR |
| Catégorie FH EUR | | | | | |
| Catégorie G | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | Investisseurs clients de la Gestion de portefeuille discrétionnaire des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et ayant conclu un accord de commissions spécifique et investisseurs autorisés | 100 EUR | 5 000 EUR |
| Catégorie GH EUR | | | | | |
| Catégorie I | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 100 EUR 100 USD 100 GBP 1 000 SEK | 1 000 000 EUR 1 000 000 USD 1 000 000 GBP 10 000 000 SEK |
| Catégorie IH EUR | | | | 100 EUR | 1 000 000 EUR |
| Catégorie IH USD | | | | 100 USD | 1 000 000 USD |
| Catégorie M | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | Investisseurs étant des entités nourricières des compartiments de la Société et investisseurs autorisés | 100 EUR 100 USD | 20 000 000 EUR 20 000 000 USD |
| Catégorie R | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR 100 USD 100 GBP 1 000 SEK | 100 EUR 100 USD 100 GBP 1 000 SEK |
| Catégorie RH EUR | | | | 100 EUR 100 USD | 100 EUR 100 USD |
| Catégorie « S » ⁽³⁾⁽⁴⁾ | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | Investisseurs autorisés | 100 EUR 100 USD 100 GBP 1 000 SEK | 20 000 000 EUR ⁽²⁾ 20 000 000 USD ⁽²⁾ 20 000 000 GBP ⁽²⁾ 200 000 000 SEK ⁽²⁾ |
| Catégorie X | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | Investisseurs institutionnels et OPC | 100 EUR 100 USD 100 GBP 1 000 SEK | 20 000 000 EUR ⁽²⁾ 20 000 000 USD ⁽²⁾ 20 000 000 GBP ⁽²⁾ 200 000 000 SEK ⁽²⁾ |

| Catégorie⁽⁴⁾ | Sous-catégorie | Enregistrement | Investisseurs | Prix de souscription initiale par Action⁽¹⁾ | Participation minimale⁽²⁾ |
|--|--|-----------------------|-------------------------|---|--|
| Catégorie « Xx » ⁽³⁾⁽⁴⁾ | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | Investisseurs autorisés | 100 EUR 100 USD 100 GBP 1 000 SEK | 50 000 000 EUR ⁽²⁾ 50 000 000 USD ⁽²⁾ 50 000 000 GBP ⁽²⁾ 500 000 000 SEK ⁽²⁾ |
| Catégorie « XxH » ⁽³⁾⁽⁴⁾ EUR | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | Investisseurs autorisés | 100 EUR | 50 000 000 EUR ⁽²⁾ |
| Catégorie Z ⁽³⁾ | Capitalisation (CAP) Distribution (DIS) | Oui | Investisseurs autorisés | 100 EUR 100 USD 100 GBP 1 000 SEK | 100 000 000 EUR ⁽²⁾ 100 000 000 USD ⁽²⁾ 100 000 000 GBP ⁽²⁾ 1 000 000 000 SEK ⁽²⁾ |

(1) Frais de souscription exclus, le cas échéant

(2) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

(3) Les Catégories Sx, X et Z seront soumises à des accords de commission spécifiques entre leurs investisseurs et la Société de gestion, tandis que des investisseurs similaires recevront un traitement égal au sein de la même catégorie d'actions.

(4) Les Actions de Catégories Sx et Xx font référence à un terme générique couvrant un nombre indéterminé de catégories d'actions pouvant être émises, chacune d'elles étant réservée à des investisseurs spécifiques et comprenant un nombre spécifique (qui est inséré juste après le nom susmentionné, par exemple : « Catégorie S1 », « Catégorie S2 », « Catégorie X1 », « Catégorie X2 », etc.). Les Actions de catégories S et X disponibles figurent sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

D'autres sous-catégories d'actions de catégories existantes peuvent être lancées de temps à autre. La liste de toutes les sous-catégories d'actions disponibles figure sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Catégories couvertes

Des catégories couvertes peuvent être créées dans certains compartiments.

Ces catégories se distinguent des autres, en couvrant leurs principaux risques de changes en rapport avec la devise de comptabilité du compartiment. Le gestionnaire tâchera de couvrir 80 à 100 % des actifs nets de la catégorie « H » concernée. En cas de changement de la valeur du portefeuille ou de souscriptions ou rachats, le taux de couverture peut être inférieur à 80 % ou supérieur à 100 % des actifs nets. Dans un tel cas, le gestionnaire tâchera de réajuster le taux de couverture entre 80 et 100 % des actifs nets. Le risque de change reste par conséquent partiellement maintenu parce que cette couverture ne peut pas englober les expositions aux devises de tous les investissements sous-jacents des compartiments concernés.

La devise de ces catégories est indiquée dans leur dénomination (par exemple « AH EUR », « CH EUR », « DH EUR », « EH EUR », « IH EUR ») pour une catégorie couverte en EUR lorsque la devise de comptabilité du compartiment est l'USD).

Les caractéristiques de ces catégories sont identiques à celles des catégories non couvertes du même compartiment.

Si aucune information particulière n'est donnée par l'investisseur, les ordres reçus seront exécutés dans la devise de référence de la catégorie. Les caractéristiques de ces catégories sont identiques à celles des catégories non couvertes du même compartiment.

Ces catégories seront créées à une date et dans des compartiments que le Conseil d'administration déterminera ultérieurement. Avant de souscrire des actions, les investisseurs sont invités à se renseigner sur les dates d'ouverture des catégories, leurs devises et les compartiments dans lesquels elles s'inscrivent.

Si la valeur des actifs de l'une de ces catégories d'un compartiment quelconque tombe en deçà d'un million d'euros ou d'un montant équivalent, le Conseil d'administration se réserve le droit de fermer la catégorie et de la fusionner avec la même catégorie non couverte du même compartiment.

Dispositions générales prévalant pour toutes les catégories

Le Conseil d'administration peut également décider à tout moment de diviser ou consolider les actions émises au sein d'un même compartiment ou d'une même catégorie ou sous-catégorie en un nombre d'actions déterminé par le Conseil lui-même. La VNI totale de telles actions doit être égale à la VNI des actions sous-divisées/consolidées existant avant l'opération de division/consolidation.

Avant de souscrire des actions, les investisseurs sont invités à vérifier dans le Livre II les catégories et sous-catégories disponibles pour chacun des compartiments.

S'il est découvert que des actions sont détenues par des personnes autres que celles autorisées, celles-ci seront converties dans la catégorie appropriée.

Les actions ont été émises sous forme nominative à compter de la date de constitution de la Société. Aucune action au porteur ne sera émise.

Le registre des actionnaires est conservé au Luxembourg et les coordonnées de l'Agent de registre sont indiquées dans la section « Informations d'ordre général ». Sauf mention contraire, les actionnaires dont les actions sont détenues sous forme nominative ne recevront pas de certificats représentant leurs actions. Ils recevront en revanche une confirmation d'entrée au registre.

Les actions doivent être intégralement libérées et sont émises à leur valeur nominale. Sauf mention contraire, leur nombre n'est pas limité. Les droits attachés aux actions sont ceux décrits dans la loi du Luxembourg du 10 août 1915, sauf exemption prévue par la Loi.

Des fractions d'actions peuvent être émises jusqu'au centième ou jusqu'au millième comme déterminé par le Conseil d'administration.

Toutes les actions de la Société sont assorties de droits de vote équivalents indépendamment de leur valeur. Les actions de chaque compartiment, catégorie ou sous-catégorie ont des droits équivalents au regard des produits de la liquidation d'un compartiment, d'une catégorie ou sous-catégorie.

Si aucune information particulière n'est donnée par l'investisseur, les ordres reçus seront exécutés dans la devise de référence de la catégorie.

Avant de souscrire des actions, les investisseurs sont invités à se renseigner sur les dates d'ouverture des catégories, leurs devises et les compartiments dans lesquels elles s'inscrivent.

DIVIDENDES

Les revenus des actions de capitalisation ne sont pas distribués et sont réinvestis.

L'Assemblée générale eu égard à la détention des actions de distribution de chaque compartiment concerné décide chaque année d'approuver ou non la proposition du Conseil d'administration de verser un dividende calculé conformément aux restrictions définies par les lois du Luxembourg et les Statuts. À cet égard, l'Assemblée générale se réserve le droit de distribuer les actifs nets de chacun des compartiments de la Société jusqu'à la limite du capital minimum légal. Le type de distribution (revenu net d'investissement ou capital) sera mentionné dans les états financiers de la Société.

Si, selon les conditions de marché, il est dans l'intérêt des actionnaires de ne pas distribuer de dividendes, alors aucune distribution ne sera réalisée.

S'il le juge recommandé, le Conseil d'administration peut décider de distribuer des acomptes sur dividendes.

Le Conseil d'administration détermine les méthodes de paiement des dividendes et des acomptes versés qu'il a été décidé de distribuer.

Les dividendes seront versés dans la devise de référence de la sous-catégorie.

Les dividendes et acomptes versés déclarés non réclamés par les actionnaires dans les cinq ans à compter de leur date de paiement seront forclos et reviendront au compartiment concerné.

Aucun intérêt ne sera payé sur les dividendes et acomptes versés déclarés non réclamés qui seront conservés par la Société pour le compte des actionnaires du compartiment pendant la durée de la période limite légale.

SOUSCRIPTION, CONVERSION ET RACHAT D'ACTIONS

Informations préliminaires

Les souscriptions, conversions ou rachats d'actions sont effectués en référence à leur VNI inconnue. Ces opérations peuvent porter sur un nombre d'actions ou un montant.

Le Conseil d'administration se réserve le droit de :

- refuser en partie ou en totalité une demande de souscription ou de conversion pour quelque motif que ce soit ;
- racheter, à tout moment des actions détenues par des personnes non autorisées à acheter ou à détenir des actions de la Société ;
- rejeter des demandes de souscriptions, conversions ou rachats effectuées par tout investisseur qu'il suspecte d'avoir recours à des pratiques de Market timing et de négociation active (Active Trading), et si nécessaire, prendre les mesures nécessaires pour protéger les autres investisseurs de la Société, notamment en facturant une commission de rachat supplémentaire de 2 % sur le montant de l'ordre, qui sera retenue par le compartiment.

Le Conseil d'administration est autorisé à fixer des montants minimums de souscription, conversion, rachat et détention.

Les souscriptions d'entités qui soumettent des demandes de souscription et dont les noms indiquent qu'elles appartiennent à un seul et même groupe, ou qui partagent un organe central de prise de décisions, seront regroupées pour calculer ces montants de souscription minimums.

Si une demande de rachat ou de conversion, une procédure de fusion/scission, ou tout autre événement a pour effet de réduire le nombre ou la valeur comptable nette des actions détenues par un actionnaire en dessous du nombre ou de la valeur décidée par le Conseil d'administration, la Société peut racheter toutes les actions.

Dans certains cas stipulés dans la section Suspension du calcul de la VNI, le Conseil d'administration est autorisé à suspendre temporairement l'émission, la conversion et le rachat des actions ainsi que le calcul de leur VNI.

Eu égard aux procédures applicables en matière de lutte contre le blanchiment d'argent, le formulaire de souscription doit être accompagné, pour les particuliers, par la carte d'identité ou le passeport du souscripteur, authentifié par une autorité compétente (par exemple, une ambassade, un consulat, un notaire ou un commissaire de police) ou par un établissement financier sous réserve de normes d'identification équivalentes à celles applicables au Luxembourg ou prévues par les Statuts ; et par un extrait du registre de commerce pour les entités juridiques, dans les cas suivants :

- lorsque la souscription est directement effectuée à la Société ;
- lorsque la souscription est effectuée à travers un intermédiaire professionnel du secteur financier résident dans un pays non soumis à l'obligation d'identification équivalente aux normes du Luxembourg concernant la prévention de l'utilisation du secteur financier à des fins de blanchiment d'argent ;
- lorsque la souscription est effectuée à travers une filiale ou une agence dont la société mère serait soumise à une obligation d'identification équivalente à celle requise en vertu des lois du Luxembourg, si la loi applicable à la société mère ne l'oblige pas à garantir que ses filiales ou agences adhèrent à ces dispositions.

La Société est également tenue d'identifier la source des fonds s'ils proviennent d'établissements financiers non soumis à une obligation d'identification équivalente à celle requise en vertu des lois du Luxembourg. Les souscriptions peuvent être provisoirement gelées jusqu'à ce que la source des fonds ait été identifiée.

Il est admis de façon générale que les professionnels du secteur financier résidant dans des pays ayant signé les conclusions du Groupe d'action financière (GAFI) sur la lutte contre le blanchiment d'argent sont réputés être tenus à l'obligation d'identification équivalente à celle requise en vertu des lois du Luxembourg.

En outre, la Société applique également des réglementations en matière de lutte contre le blanchiment d'argent et le financement du terrorisme fondées sur les lois luxembourgeoises applicables et les diverses lois et circulaires relatives à la lutte contre le blanchiment d'argent et le financement du terrorisme (y compris la loi du 12 novembre 2004 telle qu'amendée et les circulaires publiées par la CSSF).

Traitement des informations personnelles

En faisant une demande de souscription, l'investisseur autorise la Société à stocker et utiliser toutes les informations confidentielles qu'elle est susceptible d'obtenir et qui le concernent, dans l'optique de gérer le compte de l'investisseur ou les relations d'affaires qu'elle entretient avec lui. Si la situation l'exige, l'investisseur autorise également la Société à partager ces informations avec ses différents fournisseurs de services. Il convient de noter que certains fournisseurs de services établis en dehors de l'Union européenne peuvent être soumis à des règles moins exigeantes à l'égard de la préservation des informations. Les informations peuvent être utilisées à des fins de déclarations, traitements d'ordres, réponses aux requêtes des actionnaires et en leur fournissant des données sur d'autres produits et services de la Société. Ni la Société, ni sa Société de gestion ne divulgueront d'informations confidentielles concernant les actionnaires à moins que des réglementations spécifiques leur imposent de le faire.

Souscriptions

Les actions seront émises au cours correspondant à la VNI par action plus les frais de souscription comme décrit dans le Livre II.

Pour qu'un ordre soit exécuté à sa VNI un Jour de valorisation donné, il est impératif qu'il soit reçu par la Société à la date et à l'heure spécifiées dans les modalités détaillées pour chaque compartiment dans le Livre II. Les ordres reçus après l'heure limite seront exécutés à la VNI au Jour de valorisation suivant le Jour de valorisation en question.

Pour qu'il soit accepté par la Société, l'ordre doit inclure toutes les informations nécessaires à l'identification des actions de souscription et du souscripteur comme décrit ci-dessus. Les ordres doivent être envoyés par courrier postal à l'Agent de registre. Ils peuvent également être adressés à l'Agent de registre par télécopie ou un moyen de transmission électronique, à condition qu'une copie originale soit immédiatement envoyée par courrier postal.

Sauf si spécifié autrement pour un compartiment particulier, le prix de souscription de chaque action est payable dans l'une des devises de valorisation des actions concernées dans un délai défini dans le Livre II, majoré, si nécessaire, par la commission de souscription applicable. Le paiement des actions peut uniquement être effectué par virement bancaire, net de tous frais (c.-à-d. que les frais bancaires sont à la charge de l'investisseur). Le Conseil d'administration se réserve le droit de lever cette obligation et d'accepter des paiements par chèque ; cependant, la demande ne sera généralement pas traitée tant que le chèque n'aura pas été encaissé. À la demande de l'actionnaire, le paiement peut être effectué dans une autre devise que celles de valorisation, mais limitée à l'euro ou au dollar américain. Les commissions de change seront à la charge de l'actionnaire et ajoutées au prix de souscription. En cas d'absence de paiement dans les délais impartis, le Conseil d'administration se réserve le droit de demander le paiement d'intérêts par jour de retard au taux du marché.

La Société se réserve le droit de reporter et/ou d'annuler des demandes de souscription s'il n'est pas certain que le paiement exact soit reçu par le Dépositaire dans le délai imparti ou si l'ordre de souscription est incomplet. Le Conseil d'administration ou ses agents peuvent traiter la demande en appliquant des frais supplémentaires afin de refléter les intérêts dus aux taux de marché habituels ; ou en annulant, s'il y a lieu, le lot d'actions alloué, accompagné d'une demande de compensation pour toute perte subie résultant du défaut de paiement dans les délais stipulés. Les actions ne seront pas attribuées tant que la demande de souscription dûment remplie n'aura pas été reçue accompagnée du paiement ou d'un document garantissant irrévocablement le versement avant la date limite. Si le paiement est effectué au moyen d'un chèque non certifié, les actions ne seront pas attribuées tant que la confirmation du paiement n'aura pas été reçue. La Société ne peut pas être tenue responsable d'un retard de traitement des ordres lorsque ceux-ci sont incomplets.

Après la souscription, tout solde de paiement en faveur de l'actionnaire lui sera remboursé, à moins qu'il soit inférieur à 15 EUR ou, le cas échéant, sa contre-valeur dans une autre devise. Les montants non remboursés seront alors conservés par le compartiment concerné.

Le Conseil d'administration peut accepter d'émettre des actions en échange d'une contribution en nature sous forme de valeurs mobilières, conformément aux modalités prévues par les lois du Luxembourg, et en particulier, à l'obligation de la soumission d'un rapport préparé par le Commissaire aux comptes comme indiqué dans la section « Informations d'ordre général » ci-dessus et sous réserve que les valeurs mobilières satisfassent les conditions de politique et de restrictions d'investissement de la Société pour les compartiments concernés comme décrit dans le Livre II. Sauf indication contraire, les coûts de ce type de transaction seront à la charge du souscripteur.

Conversions

Sans porter atteinte aux dispositions spécifiques d'un compartiment, d'une catégorie ou sous-catégorie, les actionnaires peuvent demander qu'une partie ou la totalité de leurs actions soient converties en actions d'un autre compartiment ou d'une autre catégorie ou sous-catégorie, sous réserve toutefois que les conditions d'éligibilité de l'investisseur définies pour chacune des catégories et plus en détail dans la section « Catégories et sous-catégories d'actions » du Livre I soient remplies.

Pour qu'un ordre de conversion soit exécuté à la VNI d'un Jour de valorisation donné, il est impératif qu'il soit reçu par la Société avant la date et l'heure spécifiées pour chaque compartiment dans le Livre II. Les ordres reçus après l'heure limite seront exécutés à la VNI au prochain Jour de valorisation.

Formule de conversion

Le nombre d'actions alloué à une nouvelle catégorie sera calculé selon la formule suivante :

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

où :

- « A » représente le nombre d'actions à allouer à la nouvelle catégorie ;
- « B » représente le nombre d'actions de la catégorie d'origine à convertir ;
- « C » représente la VNI, le Jour de valorisation applicable, des actions de la catégorie d'origine à convertir ;
- « D » représente le taux de change applicable le jour de la transaction entre les devises des actions à convertir ;
- « E » représente la VNI, le Jour de valorisation applicable, des actions à allouer à la nouvelle catégorie ;
- « F » représente le taux de commission pour les conversions mentionnées dans la description de chaque compartiment du Livre II ;
- « X » représente le solde non attribué qui, le cas échéant sera remboursé à l'actionnaire. Il est rappelé aux investisseurs que la

Société peut émettre des fractions d'actions jusqu'au centième ou jusqu'au millième telles que déterminées par le Conseil d'administration.

Rachats

Sous réserve des exceptions et limites prévues dans le Prospectus, tous les actionnaires peuvent faire racheter leurs actions par la Société.

Pour qu'un ordre soit exécuté à sa VNI un Jour de valorisation donné, il est impératif qu'il soit reçu par la Société à la date et à l'heure spécifiées dans les dispositions de chaque compartiment dans le Livre II. Les ordres reçus après l'heure limite seront exécutés à la VNI au prochain Jour de valorisation.

Pour qu'il soit accepté par la Société, l'ordre doit inclure toutes les informations nécessaires à l'identification des actions en question et de l'actionnaire comme décrit ci-dessus.

Sauf si spécifié autrement pour un compartiment particulier, le montant de rachat pour chaque action sera payé dans l'une des devises de valorisation des actions concernées et dans un délai défini dans le Livre II, minoré, si nécessaire, par la commission de rachat applicable.

À la demande de l'actionnaire, le paiement peut être effectué dans une autre devise que celles de valorisation des actions rachetées, mais limitée à l'euro ou au dollar américain, auquel cas les commissions de change seront à la charge de l'actionnaire et déduites du

prix de rachat. Le prix de rachat des actions peut être supérieur ou inférieur au prix payé au moment de la souscription (ou conversion) selon que la VNI s'est appréciée ou dépréciée entre temps.

La Société se réserve le droit de reporter les demandes de rachat si l'ordre reçu est incomplet. La Société ne peut pas être tenue responsable d'un retard de traitement des ordres lorsque ceux-ci sont incomplets.

Les rachats en nature sont possibles sous réserve d'approbation spécifique du Conseil d'administration et à condition que cela n'entraîne aucun préjudice pour les actionnaires restants et que le Commissaire aux comptes fournisse un rapport de valorisation. Le type d'actifs en nature pouvant être transféré dans de tels cas sera déterminé par le gestionnaire, en prenant en compte la politique et les restrictions d'investissement du compartiment en question. Les coûts de ces transferts peuvent être pris en charge par l'actionnaire qui demande le rachat.

Si lors d'un Jour de valorisation, le total net des demandes de rachat/conversion reçu par un compartiment donné est égal ou excède 10 % des actifs nets du compartiment en question, le Conseil d'administration pourra décider de réduire et/ou de reporter proportionnellement les demandes de rachat/conversion de manière à réduire le nombre d'actions rachetées/converties à ce jour à 10 % des actifs nets du compartiment en question. Pour les demandes de rachat/conversion reportées, la priorité sera donnée à celles reçues le Jour de valorisation suivant, toujours dans la limite de 10 % des actifs nets du compartiment concerné.

Cotation boursière

Par décision du Conseil d'administration, les actions des compartiments et des catégories de la Société peuvent être admises à la cote officielle de la Bourse du Luxembourg et/ou, le cas échéant sur une autre bourse de valeurs mobilières.

CALCUL DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

Tous les calculs de VNI seront effectués comme suit sous la responsabilité du Conseil d'administration :

1. La VNI sera calculée comme spécifié dans le Livre II.
2. La VNI par action sera calculée en référence au total des actifs nets du compartiment, de la catégorie ou de la sous-catégorie correspondants. Le total des actifs nets du compartiment, de la catégorie ou de la sous-catégorie sera calculé en faisant la somme de tous les éléments d'actifs de chaque compartiment, catégorie ou sous-catégorie (y compris les attributions octroyées ou les pourcentages détenus dans certains sous-portefeuilles internes comme plus amplement décrit au point 4 ci-dessous) à laquelle seront soustraits tous les passifs et engagements y relatifs, le tout conformément au point 4 du paragraphe 4 ci-dessous.
3. La VNI par action de chaque compartiment, catégorie ou sous-catégorie sera calculée en divisant le total respectif des actifs nets de chaque compartiment, catégorie ou sous-catégorie par le nombre d'actions en circulation, jusqu'à deux ou trois décimales comme déterminé par le Conseil d'administration pour chaque compartiment, à l'exception des devises qui ne sont pas exprimées avec des décimales.
4. En interne, afin de garantir la gestion financière et administrative globale de l'ensemble d'actifs détenus par un/une ou plusieurs compartiments, catégories ou sous-catégories, le Conseil d'administration pourra créer autant de sous-portefeuilles internes que d'ensembles d'actifs à gérer (« les sous-portefeuilles internes »).

En conséquence, un/une ou plusieurs compartiments, catégories ou sous-catégories ayant complètement ou partiellement la même politique d'investissement pourront combiner leurs actifs respectifs afin d'appliquer cette politique d'investissement à un sous-portefeuille interne créé à cette fin. La part détenue par chaque compartiment, catégorie ou sous-catégorie au sein de ces sous-portefeuilles internes sera exprimée soit en termes de pourcentages soit en termes d'attributions, comme spécifié dans les deux paragraphes suivants. La création d'un sous-portefeuille interne aura pour seul objectif de faciliter la gestion financière et administrative de la Société.

Les pourcentages de détention seront uniquement établis sur la base du ratio de contribution des actifs à un sous-portefeuille interne donné. Ces pourcentages de détention seront recalculés chaque Jour de valorisation afin de prendre en compte toute émission, conversion ou distribution ou tout rachat ou autre événement généralement de toute nature affectant tout compartiment, ou toute catégorie ou sous-catégorie concerné pouvant augmenter ou diminuer leur participation dans le sous-portefeuille interne concerné.

Les attributions octroyées par un sous-portefeuille interne donné seront valorisées aussi régulièrement que les pourcentages et selon des méthodes identiques à celles mentionnées aux points 1, 2 et 3 ci-dessus. Le nombre total d'attributions octroyées variera selon les distributions, rachats, émissions, conversions ou autres événements généralement de toute nature affectant les compartiments, catégories ou sous-catégories concernées et pouvant augmenter ou diminuer leur participation dans le sous-portefeuille interne concerné.

5. Quel que soit le nombre de catégories ou sous-catégories créées dans compartiment particulier, le total des actifs nets du compartiment sera calculé selon la fréquence prévue par la Loi du Luxembourg et les Statuts du Prospectus. Le total des actifs nets de chaque compartiment sera calculé en faisant la somme des totaux des actifs nets de chaque catégorie ou sous-catégorie créée au sein du compartiment.
6. Sans préjudice des indications du point 4 au regard des attributions et pourcentages de détention et sans préjudice des règles particulières pouvant être définies pour un ou plusieurs compartiments particuliers, les actifs nets des divers compartiments seront valorisés conformément aux règles stipulées ci-dessous.

COMPOSITION DES ACTIFS

Les actifs de la Société incluent principalement :

- (1) les espèces en caisse et dépôts à vue, dont les intérêts courus, mais non encore reçus et les intérêts courus sur ces dépôts jusqu'à la date de paiement ;
- (2) tous les billets et effets payables sur simple demande et les comptes à recevoir (y compris les gains des ventes de titres avant même la réception des produits) ;
- (3) toutes les parts, actions, obligations et tous les titres, droits d'option ou de souscription et autres investissements et titres détenus en propriété par la Société ;
- (4) tous les dividendes et toutes les distributions à recevoir par la Société, en espèces ou sous forme de titres et dont elle a connaissance ;
- (5) tous les intérêts courus, mais non encore reçus et tous les intérêts générés jusqu'à la date de paiement par ces titres détenus en propriété par la Société, à moins qu'ils ne soient inclus dans le principal de ces titres ;
- (6) les dépenses de constitution de la Société dans la mesure où elles n'ont pas fait l'objet d'un amortissement ; et
- (7) tous les autres avoirs de quelque nature qu'ils soient, y compris les dépenses payées d'avance.

RÈGLES DE VALORISATION

Les actifs de chaque compartiment seront évalués comme suit :

- (1) la valeur des espèces en caisse ou des dépôts à vue, effets et billets payables à vue et des comptes à recevoir, des dépenses payées d'avance, des dividendes et intérêts dus, mais non encore perçus, comprendra la valeur nominale de ces actifs, sauf s'il s'avère improbable que cette valeur puisse être encaissée ; dans ce dernier cas, la valeur sera déterminée en retranchant un montant que la Société jugera adéquat en vue de refléter la valeur réelle de ces actifs ;
- (2) la valeur des actions ou parts d'organismes de placement collectif sera évaluée sur la base de leur dernière VNI au Jour de valorisation ;
- (3) la valeur des titres cotés sur une Bourse ou tout autre marché réglementé en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public est calculée sur la base du prix de clôture le jour d'acceptation de l'ordre et, si les titres concernés sont négociés sur plusieurs marchés, sur la base du cours le plus récent relevé sur le marché le plus important ; si le cours ne reflète pas véritablement la réalité, la valeur sera calculée sur la base du prix de vente probable estimé avec prudence et bonne foi par le Conseil d'administration ;

- (4) les titres non cotés ou non négociés sur une bourse ou un autre marché réglementé en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, seront valorisés en fonction du cours probable de leur vente estimé avec prudence et de bonne foi par un professionnel qualifié nommé à cette fin par le Conseil d'administration ;
- (5) les titres libellés dans une devise autre que celle de référence du compartiment seront convertis au taux de change en vigueur au Jour de valorisation ;
- (6) lorsque l'usage l'autorise, les liquidités, les instruments du marché monétaire et tous les autres instruments pourront être évalués à leur valeur nominale majorée des éventuels intérêts courus ou sur la base de l'amortissement linéaire. Toute décision visant à calculer la valeur des actifs du portefeuille en utilisant la méthode d'amortissement linéaire doit être approuvée par le Conseil d'administration, qui devra en indiquer les motifs et les enregistrer, conformément aux lignes d'orientation de février 2009 de l'Association luxembourgeoise des fonds d'investissement (ALFI) sur le « Calcul de l'écart entre le coût amorti et la valeur de marché concernant les fonds nécessitant une telle évaluation conformément à leur prospectus ». Le Conseil d'administration mettra en place les vérifications et contrôles concernant la valorisation des instruments ;
- (7) le Conseil d'administration est autorisé à établir ou à modifier les règles à l'égard des taux de valorisation pertinents. Les décisions prises à cet égard seront incluses dans le Livre II ;
- (8) l'IRS sera calculé sur la base de la différence entre la valeur de tous les intérêts payables par la Société à sa contrepartie à la date de valorisation au taux de swap zéro coupon correspondant à l'échéance de ces paiements et la valeur de tous les intérêts payables par la contrepartie à la Société à la date de valorisation au taux de swap zéro coupon correspondant à l'échéance de ces paiements ;
- (9) le modèle de valorisation interne des CDS utilise comme éléments de calcul, la courbe de taux des CDS, le taux de recouvrement et le taux d'actualisation (LIBOR ou taux de swap du marché) pour calculer la valeur par référence au marché. Ce modèle interne permet également d'établir la courbe de taux pour les probabilités de défaut. L'établissement de la courbe de taux des CDS s'effectue à partir des données relatives à un certain nombre de contreparties actives dans le marché des CDS. Le gestionnaire utilise les valorisations des CDS des contreparties afin de les comparer avec les valeurs obtenues à partir du modèle interne. Le point de départ pour la construction du modèle interne est la parité existant entre la part variable et la part fixe du CDS lors de la conclusion du CDS ;
- (10) étant donné que les EDS sont déclenchés par un événement portant sur une action, leur valorisation dépend principalement de la volatilité de l'action et de sa position asymétrique. Plus la volatilité est élevée, plus le risque que l'action atteigne le seuil de 70 % est important et par conséquent, plus le spread de l'EDS sera élargi. Le spread du CDS d'une société reflète également sa volatilité, étant donné que la volatilité élevée des actions indique une volatilité élevée des actifs de la société en question et par conséquent une probabilité élevée d'un événement de crédit. Étant donné que les spreads des EDS et CDS sont corrélés avec une volatilité implicite des actions et que ces relations ont tendance à rester stables au cours du temps, un EDS peut être considéré comme un représentant du CDS. Le point essentiel dans la valorisation d'un EDS est de calculer la volatilité implicite d'un événement affectant l'action de la société en question. Deux méthodes sont généralement acceptées : la première consiste à utiliser le spread de marché du CDS dans le modèle d'évaluation de l'EDS ; la seconde consiste à utiliser les données historiques relatives à l'action en question afin d'estimer la probabilité de l'événement. Bien que les données historiques ne soient pas nécessairement une indication appropriée de ce qui peut se produire à l'avenir, elles reflètent le comportement général d'une action dans une situation de crise. Si l'on compare les deux approches, il est très rare d'observer des probabilités historiques qui soient plus élevées que les probabilités implicites ;

COMPOSITION DES PASSIFS

Les passifs de la Société incluent principalement :

- (1) tous les emprunts, les effets échus et les comptes à payer ;
- (2) tous les passifs connus, dus ou non, y compris toutes les obligations contractuelles dues et relatives à des paiements en numéraire ou en nature, dont le montant des dividendes annoncé par la Société et non encore versé ;
- (3) toutes les réserves autorisées ou approuvées par le Conseil d'administration, y compris les réserves effectuées pour couvrir les pertes en capital potentielles portant sur les investissements de la Société ;
- (4) tous les autres engagements donnés par la Société, à l'exception de ceux représentés par les capitaux propres de la Société. Pour la valorisation de ces actifs, la Société doit prendre en compte tous les frais y afférents, y compris et sans restrictions, les coûts des amendements apportés aux Statuts, du Prospectus et de tous les documents relatifs à la Société, les commissions de gestion, de performance et autres commissions et charges exceptionnelles, tous les droits et taxes payables aux différents organes du gouvernement et aux Bourses de valeurs, ainsi que les frais financiers, bancaires ou de courtage engagés lors de l'achat ou la vente d'action ou autrement. Lors de l'évaluation de ces passifs, la Société doit prendre en compte les dépenses administratives courantes et autres sur une base prorata temporis.

Les actifs, passifs, frais et commissions non affectés à un compartiment, une catégorie ou sous-catégorie seront alloués aux différents compartiments et différentes catégories ou sous-catégories proportionnellement à leurs actifs nets respectifs. Toute action de la Société engagée dans un processus de rachat doit être considérée comme une action émise et existant jusqu'au Jour de valorisation du rachat de ladite action et son prix sera considéré comme un passif de la Société à compter de la date de clôture en question jusqu'à ce que le prix ait dûment été payé. La valeur de chaque action devant être émise par la Société conformément aux demandes de souscription reçues sera considérée comme un montant dû à la Société jusqu'à ce qu'il soit reçu en bonne et due forme. Autant que possible tout investissement ou désinvestissement décidé par la Société devra être pris en compte jusqu'au Jour de valorisation.

SUSPENSION DU CALCUL DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE, DES ÉMISSIONS, CONVERSIONS ET RACHATS D' ACTIONS

Sans porter atteinte aux motifs de suspension légaux, le Conseil d'administration peut à tout moment suspendre de manière temporaire le calcul de la VNI des actions d'un ou de plusieurs compartiments, ainsi que les émissions, conversions et rachats dans les cas suivants :

- (a) toute période au cours de laquelle un ou plusieurs marchés de devises ou d'actions sur lesquels une part substantielle des investissements du compartiment est principalement cotée à un moment donné sont fermés, à l'exception des jours de clôture habituels, ou durant laquelle la négociation est suspendue ou soumise à des restrictions majeures ;
- (b) lorsque des circonstances politiques, économiques, militaires, monétaires ou sociales ou un cas de force majeure échappant à la responsabilité ou au contrôle de la Société rendent impossible la vente d'actifs donnés dans des conditions raisonnables et normales sans compromettre gravement les intérêts des actionnaires ;

- (c) pendant une panne des moyens de communication normalement employés pour déterminer le prix de l'un quelconque des investissements de la Société ou les cours actuels sur un marché ou une Bourse particulière ;
- (d) lorsque les restrictions sur les changes ou le transfert de capitaux empêchent la conclusion de transactions pour le compte de la Société ou lorsque les achats ou ventes des actifs de la Société ne peuvent être effectués à des taux de change normaux ;
- (e) dès que la décision de liquider la Société ou l'un/l'une ou plusieurs compartiments, catégories ou sous-catégories a été prise ;
- (f) pour déterminer un rapport d'échange en vertu d'une fusion, du transfert partiel d'une activité, d'une scission ou d'une opération de restructuration au sein d'un/d'une ou de plusieurs compartiments, catégories ou sous-catégories ;
- (g) pour un compartiment « Nourricier », lorsque la VNI, l'émission, la conversion ou le rachat de parts ou d'actions du compartiment « Maître » sont suspendus ;
- (h) dans tout autre cas où le Conseil d'administration estime qu'une suspension est nécessaire pour préserver les intérêts généraux des actionnaires concernés et justifie sa décision.

En cas de suspension du calcul de la VNI, la Société devra immédiatement et de manière appropriée informer les actionnaires ayant fait une demande de souscription, de conversion ou de rachat d'actions du ou des compartiments en question.

Dans des circonstances exceptionnelles qui pourraient avoir un impact négatif pour les intérêts des actionnaires, ou en cas de demandes de souscription, rachat ou conversion excédant 10 % des actifs nets d'un compartiment, le Conseil d'administration se réserve le droit de ne pas déterminer la valeur d'une action tant que les achats et ventes de titres n'ont pas été effectués pour le compte du compartiment. Dans cette éventualité, les souscriptions, rachats et conversions en processus de traitement seront exécutés au moment même où la VNI sera calculée.

Les demandes de souscriptions, rachats et conversions en attente peuvent être retirées par notification écrite sous réserve d'être reçues par la Société avant la levée de la suspension. Les demandes en attente seront prises en compte pour le premier calcul effectué après la levée de la suspension. Si toutes les demandes en attente ne peuvent pas être traitées lors d'une même date de calcul, les premières demandes reçues seront exécutées en priorité sur les dernières.

AJUSTEMENT DE LA VNI (SWING PRICING)

Dans certaines circonstances, les souscriptions, rachats et conversions dans un compartiment peuvent avoir un impact négatif sur la Valeur nette d'inventaire par action. Lorsque les souscriptions, les rachats et les conversions d'un compartiment amènent le compartiment à acheter et/ou à vendre des investissements sous-jacents, la valeur de ces investissements peut être affectée par les écarts cours acheteur/cours vendeur, les coûts liés à la négociation et les frais connexes, y compris les frais de transaction, les frais de courtage et les taxes. Cette activité d'investissement peut avoir un impact négatif sur la Valeur nette d'inventaire par action appelée « dilution ». Afin de protéger les investisseurs existants ou restants de l'effet potentiel de dilution, le compartiment peut appliquer un Ajustement de la VNI (Swing Pricing) sur l'activité de capital au niveau du compartiment et ne traite pas des circonstances spécifiques de chaque transaction d'investisseur, comme expliqué plus en détail ci-dessous.

Sauf indication contraire dans la description du compartiment concerné dans le Livre II, tout Ajustement de la VNI (Swing Pricing) peut être ajouté au prix auquel les actions seront émises en cas de demandes de souscription nette dépassant un certain seuil fixé ponctuellement par le Conseil d'administration (Appelé « Seuil de Swing Pricing ») et déduit du prix auquel les actions seront rachetées dans le cas de demandes de rachat net dépassant un certain seuil fixé par le Conseil d'administration en tant que de besoin.

L'Ajustement de la VNI (Swing Pricing) consiste à ajuster la Valeur nette d'inventaire par action pour tenir compte des coûts totaux d'achat et/ou de vente des investissements sous-jacents. La Valeur nette d'inventaire par action sera ajustée d'un certain pourcentage fixé par le Conseil d'administration de temps à autre pour chaque compartiment, appelé le « Facteur de Swing », qui représente l'écart estimé entre les cours acheteur et vendeur des actifs dans lesquels le compartiment investit et l'estimation de la taxe, des coûts liés à la négociation, ainsi que les frais connexes qui peuvent être encourus par le compartiment en raison de l'achat et/ou de la vente d'investissements sous-jacents (Facteur de Swing). Comme certains marchés d'actions et juridictions peuvent avoir des structures de frais différentes pour les opérations d'achat et de vente, le Facteur de Swing peut être différent pour les souscriptions nettes et les rachats nets d'un compartiment. En règle générale, le Facteur de Swing ne dépassera pas deux pour cent (2 %) de la Valeur nette d'inventaire par action. Néanmoins, dans des circonstances extraordinaires, notamment politiques, militaires, économiques, financières, monétaires, sanitaires ou autres situations d'urgence échappant au contrôle, à la responsabilité et à l'influence de la Société de gestion, le Facteur de Swing maximum pourrait être relevé temporairement au-delà du pourcentage maximum susmentionné. Le Facteur de Swing qui s'applique à un compartiment spécifique est disponible sur simple demande auprès de la Société de gestion. Un examen périodique sera effectué afin de vérifier l'adéquation du Facteur de Swing au regard des conditions de marché.

Le Conseil d'administration déterminera s'il convient d'appliquer un Swing partiel ou total. En cas d'adoption d'un Swing partiel, la Valeur nette d'inventaire par action sera ajustée à la hausse ou à la baisse si les souscriptions ou rachats nets d'un compartiment dépassent un certain seuil fixé par le Conseil d'administration de temps à autre pour chaque compartiment (appelé Seuil de Swing). Si un Swing complet est adopté, aucun seuil de Swing ne s'applique. Le Facteur de Swing aura l'effet suivant sur les souscriptions ou les rachats :

- 1) lorsqu'un compartiment connaît des niveaux de souscriptions nettes un Jour de valorisation (c'est-à-dire que la valeur des souscriptions est supérieure aux rachats) (au-delà du Seuil de Swing, le cas échéant), la Valeur nette d'inventaire par action sera ajustée à la hausse par le Facteur de Swing ; et
- 2) Lorsqu'un compartiment connaît des niveaux de rachats nets un Jour d'évaluation (c'est-à-dire que la valeur des rachats est supérieure aux souscriptions) (au-delà du Seuil de Swing, le cas échéant), la Valeur nette d'inventaire par action sera ajustée à la baisse par le Facteur de Swing.

La volatilité de la Valeur nette d'inventaire du compartiment peut ne pas refléter la performance réelle du portefeuille (et peut donc s'écarter de l'indice de référence du compartiment, le cas échéant) du fait de l'application de l'Ajustement de la VNI (Swing Pricing). La commission de performance, le cas échéant, sera prélevée sur la base de la Valeur nette d'inventaire non Swinguée du compartiment.

RÉGIME FISCAL DE LA SOCIÉTÉ

À la date du Prospectus, la Société n'est pas soumise à un quelconque impôt sur le revenu, impôt sur les plus-values ou impôt sur la fortune applicable au Luxembourg.

La Société est soumise à une Taxe d'abonnement annuelle en vigueur au Luxembourg représentant 0,05 % de la VNI. Ce taux est réduit à 0,01 % pour :

- a) les compartiments exclusivement axés sur les investissements collectifs dans des instruments du marché monétaire et des dépôts auprès d'établissements de crédit ;
- b) les compartiments exclusivement axés sur les investissements collectifs dans des dépôts auprès d'établissements de crédit ;
- c) les compartiments, catégories ou sous-catégories réservés aux Investisseurs institutionnels et/ou aux Gestionnaires et/ou aux OPC.

Le paiement de la Taxe d'abonnement n'est pas requis dans les cas suivants :

- a) la valeur des actifs représentés par des parts ou actions d'autres OPC, à condition que ces parts ou actions aient déjà été soumises à la Taxe d'abonnement ;
- b) les compartiments, catégories et/ou sous-catégories :
 - (i) dont les titres sont réservés aux investisseurs institutionnels ;
 - (ii) exclusivement axés sur les investissements collectifs dans des instruments du marché monétaire et le placement de dépôts auprès d'établissements de crédit ; et
 - (iii) dont l'échéance résiduelle pondérée de portefeuille ne dépasse pas 90 jours ; et
 - (iv) qui ont obtenu la note la plus élevée possible de la part d'une agence de notation reconnue.

Lorsque le compartiment comprend plusieurs catégories d'actions, l'exonération ne s'applique qu'aux catégories d'actions réservées aux investisseurs institutionnels.

- c) les compartiments, catégories et/ou sous-catégories réservés aux :
 - (i) établissements de retraite professionnelle ou véhicules d'investissement similaires, établis à l'initiative d'un ou plusieurs employés pour le bénéfice de leurs employés ;
 - (ii) sociétés investissant des fonds pour offrir des prestations de retraites à leurs employés ;
- d) les compartiments dont l'objectif exclusif consiste à investir dans des établissements spécialisés dans la microfinance ;
- e) les compartiments, catégories et/ou sous-catégories :
 - (i) dont les titres sont cotés ou négociés au moins sur une Bourse ou un autre marché réglementé, fonctionnant régulièrement, et reconnu et ouvert au public ; et
 - (ii) dont l'objet exclusif est de répliquer le rendement d'un ou de plusieurs indices.

Lorsque le compartiment comprend plusieurs catégories d'actions, l'exonération ne s'applique qu'aux catégories d'actions qui remplissent la condition de l'alinéa (i).

Lorsqu'elle est due, la Taxe d'abonnement est payable trimestriellement sur les actifs nets concernés et calculée à la fin du trimestre auquel elle se rapporte.

Par ailleurs, la Société peut être soumise au paiement d'un impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

RÉGIME FISCAL DES INVESTISSEMENTS DE LA SOCIÉTÉ

Certains revenus du portefeuille de la Société, notamment les dividendes et revenus d'intérêts, ainsi que certaines plus-values peuvent être sujets à plusieurs taux d'imposition et des taxes de nature différente selon les pays où ils sont générés. En principe, ces revenus et plus-values sont également susceptibles d'être soumis à une imposition à la source. À cet égard, certains traités de double imposition conclus par le Grand-Duché de Luxembourg ont néanmoins été établis afin de limiter ce risque d'impôts à payer.

IMPOSITION DES ACTIONNAIRES

Actuellement, les actionnaires ne sont soumis à aucun impôt à la source ou payable sur les plus-values, le revenu, les donations, les biens immobiliers ou la succession et à aucune autre taxe eu égard aux actions qu'ils détiennent (à l'exception, le cas échéant, des actionnaires qui ont leur domicile, leur résidence ou qui sont définitivement établis au Luxembourg ou qui ont eu leur domicile ou leur résidence dans ce pays).

Les investisseurs potentiels sont invités à s'informer des impôts applicables à l'acquisition, la détention et la cession d'actions de la Société ainsi qu'à leur distribution en vertu des lois du ou des pays dont ils sont ressortissants ou dans lesquels ils résident ou sont domiciliés.

a) Dispositions de la FATCA

Les dispositions de la FATCA telles que transposées dans la loi FATCA du Luxembourg exigent que la propriété directe ou indirecte de comptes non américains et d'entités non américaines, appartenant à des Ressortissants américains soit déclarée annuellement. Les autorités fiscales luxembourgeoises communiquent automatiquement ces informations aux autorités fiscales américaines (IRS, Internal Revenue Service). Le fait de ne pas fournir ces informations peut entraîner, en plus de pénalités à payer au Luxembourg, une retenue fiscale à la source de 30 % eu égard à certains revenus d'origine américaine (incluant les dividendes et les intérêts) et aux revenus bruts provenant de la vente ou de toute autre cession de biens, susceptible de générer des intérêts et des dividendes d'origine américaine.

Les dispositions qui précèdent se basent sur la loi FATCA du Luxembourg et les pratiques actuellement en vigueur et peuvent faire l'objet de modifications ultérieures. Il est conseillé aux investisseurs potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement. Nous attirons l'attention des investisseurs sur l'existence de certaines dispositions fiscales dans certains pays où la Société commercialise ses actions auprès du public.

b) Norme commune de déclaration (NCD)

L'OCDE a été mandatée par les pays du G8/G20 afin de développer une norme de déclaration internationale visant à permettre à l'avenir un échange automatique d'informations (« EAI ») multilatéral et complet à l'échelle mondiale. La NCD exige des établissements financiers du Luxembourg qu'ils identifient leurs titulaires de compte (y compris, dans le cas d'une entité de placement, les détenteurs d'actions et d'obligations) et déterminent s'il s'agit de résidents fiscaux de pays signataires de l'accord multilatéral NCD. Les établissements financiers du Luxembourg déclareront donc aux autorités fiscales du Luxembourg les informations financières relatives

aux détenteurs de comptes, lesquelles seront automatiquement transférées chaque année aux autorités fiscales étrangères compétentes.

La NCD a été intégrée à la Directive relative à la coopération administrative (« DAC 2 ») adoptée le 9 décembre 2014, que les États membres de l'UE devaient transposer dans leur droit national avant le 31 décembre 2015. À cet égard, la loi sur la NCD du Luxembourg datée du 18 décembre 2015 (la « Loi EAI ») a été publiée dans le Mémorial A – N°244 le 24 décembre 2015.

Les autorités fiscales des États membres de l'UE (et également celles des autres membres de l'OCDE comptant parmi les premiers pays ayant adopté la norme) devront d'abord s'échanger la première déclaration d'informations entre elles en vertu de la DAC 2 au plus tard à la fin du mois de septembre 2017 pour les informations financières portant sur l'année 2016. L'application de l'EAI ou de la NCD dans les autres juridictions n'aura pas lieu avant 2017 et dépendra du pays considéré.

c) Protection des données à caractère personnel

Conformément à la Loi EAI et aux règles sur la protection des données du Luxembourg, chaque investisseur particulier concerné sera informé du traitement de ses données à caractère personnel avant qu'elles ne soient traitées par l'Établissement financier déclarant du Luxembourg. Si l'investisseur particulier remplit les conditions requises pour être qualifié de Personne déclarante dans le contexte susmentionné, il sera tenu informé par la Société conformément à la loi sur la protection des données du Luxembourg.

- À cet égard, la Société, en tant qu'Établissement financier déclarant du Luxembourg sera responsable du traitement des données à caractère personnel et agira en qualité d'agent de traitement des données aux fins de la Loi EAI. Les données à caractère personnel sont destinées à être traitées aux fins de la Loi EAI et de la NCD/DAC 2.
- Les données peuvent être transmises aux autorités fiscales du Luxembourg (Administration des contributions directes), qui peuvent à leur tour transmettre ces données aux autorités compétentes d'une ou plusieurs Juridictions déclarantes.
- L'investisseur particulier concerné devra obligatoirement répondre à chaque demande d'informations qui lui aura été envoyée aux fins de la Loi EAI. L'absence de réponse dans les délais impartis peut résulter en une déclaration du compte aux autorités fiscales du Luxembourg incorrecte ou faite en double.
- Chaque investisseur individuel concerné a le droit d'accéder aux données transmises aux autorités fiscales du Luxembourg aux fins de la Loi EAI, et de les modifier en cas d'erreur.

La totalité des données à caractère personnel des actionnaires contenues dans tout document fourni par ces actionnaires et toutes autres données à caractère personnel recueillies dans le cadre de la relation avec la Société peuvent être recueillies, enregistrées, stockées, adaptées, transférées ou bien traitées et utilisées (ci-après « traitées ») par la Société ou la Société de gestion. Ces données seront traitées aux fins de la gestion des comptes, de la vérification de l'identité dans le cadre de la lutte contre le blanchiment d'argent et de l'établissement de relations d'affaires. À cette fin, les données peuvent être transférées à des sociétés désignées par la Société ou par la Société de gestion afin de soutenir les activités de ladite Société.

En signant le contrat de souscription, chaque actionnaire convient au traitement de ses données à caractère personnel, conformément au cadre réglementaire en vigueur relatif à la protection des personnes à l'égard du traitement des données à caractère personnel.

De plus amples détails sur les conditions et les modalités concernant le traitement des données sont disponibles sur demande et gratuitement au siège social de la Société.

La Société, en sa qualité de responsable du traitement des données, recueille, stocke et traite, par voie électronique ou autre, les données fournies par les Actionnaires au moment de leur souscription dans le but de fournir les services demandés par les actionnaires et de respecter ses obligations légales.

Toutes les données recueillies par la Société doivent être traitées conformément à la loi sur la protection des données applicable au Grand-Duché de Luxembourg et à la Loi sur la protection des données.

Les données traitées comprennent le nom de chaque actionnaire, son adresse et le montant qu'il a investi, ainsi que les données demandées par la Société afin de garantir la conformité de la Société aux règles en vigueur en matière de lutte contre le blanchiment d'argent/connaissance du client et de financement du terrorisme, ainsi que des règles de la FATCA et de la NCD (les « Données à caractère personnel »).

L'investisseur peut, à sa discrétion, refuser de communiquer des Données à caractère personnel à la Société. Dans ce cas, toutefois, la Société peut rejeter sa demande de souscription d'Actions de la Société.

Les données fournies par les actionnaires sont notamment traitées aux fins suivantes : (i) la tenue du registre des actionnaires ; (ii) le traitement des souscriptions, rachats et conversions d'actions, ainsi que le paiement de dividendes aux actionnaires ; (iii) le contrôle des opérations hors délais et des pratiques de market timing ; et (iv) le respect des règles en vigueur en matière de lutte contre le blanchiment d'argent/connaissance du client et de financement du terrorisme, ainsi que des règles de la FATCA et de la NCD.

La Société peut déléguer à une autre entité située dans l'Union européenne (la Société de gestion, le Distributeur, l'Agent administratif, le Gestionnaire d'investissement (le cas échéant) ou l'Agent de registre) le traitement des données à caractère personnel. La Société peut également transférer des Données à caractère personnel à des tiers tels que des organismes d'État ou de réglementation, notamment les autorités fiscales, situés au sein et en dehors de l'Union européenne, conformément aux lois et réglementations en vigueur.

L'actionnaire a le droit :

- d'accéder à ses Données à caractère personnel ;
- de corriger ses Données à caractère personnel si elles sont inexacts ou incomplètes ;
- de s'opposer au traitement de ses Données à caractère personnel ;
- de demander la suppression de ses Données à caractère personnel ;
- de requérir la portabilité de ses Données à caractère personnel sous certaines conditions.

L'actionnaire a également le droit de s'opposer à l'utilisation de ses Données à caractère personnel à des fins de commercialisation.

L'actionnaire peut exercer les droits susmentionnés en écrivant au siège social de la Société.

L'actionnaire reconnaît également avoir le droit de déposer une plainte auprès de la Commission Nationale de l'Informatique et des Libertés.

Les Données à caractère personnel ne seront conservées que pendant le temps nécessaire à leur traitement, sous réserve de la période de prescription légale.

ASSEMBLÉES GÉNÉRALES D'ACTIONNAIRES

L'Assemblée générale annuelle de la Société se tiendra dans les six mois qui suivront la fin de l'exercice précédent au siège social de la Société ou dans tout autre lieu du Grand-Duché de Luxembourg spécifié dans la convocation. Si ce jour n'est pas un jour ouvrable au Luxembourg, l'Assemblée générale annuelle se tiendra le jour ouvrable suivant. D'autres Assemblées générales pourront avoir lieu conformément aux dispositions des lois du Luxembourg et des Statuts de la Société.

Les convocations des actionnaires aux Assemblées générales seront publiées sous la forme et dans les délais prescrits par les lois du Luxembourg et les Statuts de la Société, avec un préavis minimum de 14 jours. Les convocations des actionnaires aux Assemblées générales pourront également leur être envoyées par courrier, outre les conventions de publication standards.

Les Assemblées générales seront conduites conformément aux dispositions des lois du Luxembourg et des Statuts de la Société.

Chaque action confère une voix à son détenteur indépendamment de sa valeur. Toutes les actions pèsent le même poids dans les décisions prises à l'Assemblée générale quand celles-ci concernent la Société dans son ensemble. Lorsque les décisions se rapportent aux droits spécifiques d'actionnaires d'un compartiment ou d'une catégorie ou sous-catégorie, seuls lesdits actionnaires sont autorisés à voter.

INFORMATIONS À L'ATTENTION DES ACTIONNAIRES**Valeur nette d'inventaire et dividendes**

La Société publie les informations légalement requises dans le Grand-Duché de Luxembourg et dans tous les autres pays où les actions sont cotées.

Ces informations sont également disponibles sur le site Internet : www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Exercice financier

L'exercice financier de la Société commence le 1^{er} janvier et se termine le 31 décembre.

Rapports financiers

La Société publie un rapport annuel dont les comptes sont arrêtés le dernier jour de l'exercice financier, certifié par les commissaires aux comptes ainsi qu'un rapport semestriel intermédiaire non certifié dont les comptes sont arrêtés le dernier jour du premier semestre de l'exercice financier. La Société est autorisée à publier une version simplifiée du rapport financier lorsque requis.

Les rapports financiers de chaque compartiment sont publiés dans la devise de référence du compartiment bien que les comptes consolidés de la Société soient exprimés en euros.

Le rapport annuel est publié dans un délai de quatre mois à compter de la clôture de l'exercice financier et le rapport intermédiaire dans les deux mois à compter de la fin du premier semestre.

Documents disponibles pour consultation

Les Statuts, le Prospectus, les DICI et les rapports périodiques peuvent être consultés au siège social de la Société et auprès des établissements qui fournissent des services financiers pour son compte. Les copies des Statuts et des rapports annuel et semestriel sont disponibles sur demande.

Les informations concernant les changements relatifs à la Société seront publiées sur le site Internet de la Société de gestion ou dans tous les journaux (versions en ligne ou papier) jugés appropriés par le Conseil d'administration dans les pays où la Société commercialise ses actions auprès du public.

Ces documents et informations seront disponibles sur le site Internet : www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Questions et réclamations de la part des investisseurs

Les investisseurs peuvent adresser leurs questions et réclamations concernant la Société en envoyant un courrier au siège social de la Société :

49, avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

ANNEXE 1 – RESTRICTIONS D'INVESTISSEMENT

1. Les investissements d'un compartiment se composent d'un ou plusieurs des éléments suivants :
 - a) valeurs mobilières et instruments du marché monétaire cotés ou négociés sur un marché réglementé comme défini par la Directive 2004/39 ;
 - b) valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché d'un État membre de l'Union européenne réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public ;
 - c) valeurs mobilières et instruments du marché monétaire officiellement cotés sur un autre marché d'actions d'un État ne faisant pas partie de l'Union européenne ou négocié sur un autre marché dans l'un de ces États, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public ;
 - d) valeurs mobilières et instruments du marché monétaire nouvellement émis, sous réserve que :
 - les conditions d'émission comportent l'engagement que la demande d'admission à la cote officielle d'une bourse de valeurs ou à un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public soit introduite ;
 - l'admission à la cote soit obtenue dans l'année suivant leur émission ;
 - e) parts ou actions d'OPCVM autorisés en vertu de la Directive 2009/65 et/ou autres OPC, qu'ils soient établis ou non dans un État membre de l'Union européenne, sous réserve que :
 - ces autres organismes de placement collectif soient autorisés conformément à la législation exigeant que ces entités soient soumises à une surveillance que la CSSF considère comme équivalente à celle prévue par la législation de l'Union européenne et que la coopération entre les autorités de surveillance soit suffisamment garantie ;
 - le niveau de protection garanti aux porteurs de parts ou actionnaires de ces autres OPC soit équivalent à celui prévu pour les porteurs de parts d'un OPCVM et, en particulier, que les règles relatives à la ségrégation des actifs, aux emprunts, aux prêts et aux ventes à découvert de valeurs mobilières et d'instruments du marché monétaire soient équivalentes aux exigences de la Directive 2009/65 ;
 - les activités de ces autres OPC soient décrites dans les rapports annuels et intermédiaires reportant la valorisation des actifs et passifs ainsi que les revenus et les transactions concernant la période en question ;
 - la part des actifs d'OPCVM ou d'autres OPC devant être acquis et qui, conformément aux réglementations des statuts en matière de gestion, peut être investie en parts ou actions d'autres OPCVM ou autres OPC, n'excède pas 10 %.
 - f) dépôts auprès d'un établissement de crédit remboursables sur demande ou pouvant être retirés et ayant une échéance inférieure ou égale à 12 mois, sous réserve que l'établissement de crédit ait son siège social dans un État membre de l'Union européenne ou, si son siège social se situe dans un autre pays, que celui-ci soit soumis à des règles prudentielles considérées par la CSSF comme équivalentes à celles prévues par la législation de l'Union européenne ;
 - g) instruments financiers dérivés, y compris les instruments équivalents donnant lieu à un règlement en espèces, négociés sur un marché réglementé visé aux dispositions a), b) et c) ci-dessus et/ou instruments financiers dérivés négociés de gré à gré (« **dérivés de gré à gré** »), sous réserve que :
 - les actifs sous-jacents consistent en des instruments décrits au point 1., des indices financiers, des taux d'intérêt, des devises ou des taux de change, dans lesquels le compartiment correspondant peut investir conformément aux objectifs d'investissement comme décrit dans les Statuts ;
 - les contreparties aux transactions sur instruments dérivés de gré à gré soient des établissements soumis à une surveillance prudentielle et appartenant aux catégories agréées par la CSSF ; et
 - les instruments dérivés de gré à gré soient soumis à une évaluation fiable et vérifiable sur une base quotidienne et puissent, à la libre initiative de la Société, être vendus, soldés ou clôturés par une transaction visant à les compenser à tout moment à leur juste valeur.
 - h) instruments du marché monétaire non négociés sur un marché réglementé et spécifiés à l'article 1 de la Loi, pour autant que l'émission ou l'émetteur de ces instruments soient soumis eux-mêmes à une réglementation visant à protéger les investisseurs et l'épargne, et que ces investissements soient :
 - émis ou garantis par une autorité centrale, régionale ou locale, par la banque centrale d'un État membre, par la Banque centrale européenne, par l'Union européenne ou par la Banque européenne d'investissement, par un État tiers ou, dans le cas d'un État fédéral, par un des membres composant la fédération, ou par un organisme public international dont font partie un ou plusieurs États membres ; ou
 - émis par une entreprise dont des titres sont négociés sur les marchés réglementés visés aux dispositions a), b) ou c) ci-dessus ; ou
 - émis ou garantis par un établissement soumis à une surveillance prudentielle selon les critères définis par la législation de l'Union européenne, ou par un établissement qui est soumis et qui se conforme à des règles prudentielles considérées par la CSSF comme au moins aussi strictes que celles prévues par la législation européenne ; ou
 - émis par d'autres entités appartenant aux catégories approuvées par la CSSF pour autant que les investissements dans ces instruments soient soumis à des règles de protection des investisseurs qui soient équivalentes à celles prévues aux premier, deuxième et troisième sous-paragraphes ci-dessus, et que l'émetteur soit une société dont le capital et les réserves s'élèvent au moins à dix millions d'euros (10 000 000 euros) et qui présente et publie ses comptes annuels conformément à la Quatrième directive 78/660/CEE, soit une entité qui, au sein d'un groupe de sociétés incluant une ou plusieurs sociétés cotées, se consacre au financement du groupe ou soit une entité qui se consacre au financement de véhicules de titrisation bénéficiant d'une ligne de financement bancaire.
2. Cependant, un compartiment ne peut :
 - a) investir plus de 10 % de ses actifs en valeurs mobilières ou instruments du marché monétaire autres que ceux mentionnés au paragraphe 1 ;
 - b) acquérir des métaux précieux ou des certificats y relatifs ;Un compartiment peut, à titre accessoire, détenir des liquidités.
3. La Société peut acquérir des biens mobiliers et immobiliers pour l'exécution directe de son activité.
4.
 - a) Un compartiment ne peut investir plus de 10 % de ses actifs dans des valeurs mobilières ou instruments du marché monétaire d'un seul et même émetteur.
Un compartiment ne peut investir plus de 20 % de ses actifs dans des dépôts réalisés auprès d'une seule et même entité.
Le risque de contrepartie d'un compartiment dans le cadre d'une transaction sur dérivés de gré à gré ne peut excéder 10 % de ses actifs lorsque la contrepartie est un établissement de crédit mentionné à la disposition 1.f) ou 5 % de ses actifs dans les autres cas.

- b) La valeur totale des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire détenus par un compartiment, d'émetteurs dans lesquels il investit plus de 5 % de ses actifs ne doit pas excéder 40 % de la valeur de ses actifs. Cette restriction ne s'applique pas aux dépôts et transactions sur dérivés de gré à gré effectués auprès d'établissements financiers soumis à une surveillance prudentielle.

Nonobstant les limites individuelles définies à la disposition a), un compartiment ne peut combiner les placements indiqués à continuation lorsque cette combinaison revient à investir plus de 20 % de ses actifs dans une seule et même entité :

- investissements dans des valeurs mobilières ou instruments du marché monétaire émis par cette entité,
- dépôts auprès de cette entité, ou
- transactions sur dérivés de gré à gré conclues avec cette entité

- c) La limite stipulée au premier paragraphe de la disposition a) peut être portée à un maximum de 35 % si les valeurs mobilières ou les instruments du marché monétaire sont émis ou garantis par un État membre de l'Union européenne, ses collectivités territoriales, un État tiers ou un organisme international à caractère public dont un ou plusieurs États membres font partie.

- d) La limite stipulée au premier paragraphe de la disposition a) peut être portée à un maximum de 25 % pour les obligations garanties telles que définies à l'article 3(1) de la Directive (UE) 2019/2162 du Parlement européen et du Conseil du 27 novembre 2019 concernant l'émission d'obligations garanties et la surveillance publique des obligations garanties et modifiant les directives 2009/65/CE et 2014/59/UE (la « Directive (UE) 2019/2162 »), et pour certaines obligations, si elles sont émises avant le 8 juillet 2022 par un établissement de crédit dont le siège social est situé dans un État membre de l'Union européenne et qui est légalement soumis à une surveillance spéciale des autorités publiques visant à protéger les détenteurs d'obligations. En particulier, les sommes découlant de ces obligations émises avant le 8 juillet 2022 doivent être investies, conformément à la législation, dans des actifs qui, durant toute la période de validité de ces obligations, peuvent couvrir les créances y associées et qui, en cas de faillite de l'émetteur, seraient utilisés en priorité pour le remboursement du principal et le paiement des intérêts courus.

Si un compartiment investit plus de 5 % de ses actifs dans des obligations mentionnées au premier paragraphe et émises par un seul et même émetteur, la valeur totale de ces investissements ne peut dépasser 80 % de la valeur de ses actifs.

- e) les valeurs mobilières et instruments du marché monétaire mentionnés aux dispositions c) et d) ne s'inscrivent pas dans la condition de restriction de 40 % mentionnée à la disposition b).

Les limites stipulées aux dispositions a), b), c) et d) ne peuvent pas être combinées ; par conséquent, les investissements dans des valeurs mobilières ou des instruments du marché monétaire émis par une seule et même entité ou dans des dépôts ou des instruments dérivés effectués auprès de cette entité, conformément aux dispositions a), b), c) et d) ne devront pas dépasser au total 35 % des actifs du compartiment.

Les sociétés qui sont regroupées aux fins de consolidation des comptes, au sens de la Directive 83/349 ou conformément aux règles comptables internationales reconnues sont considérées comme une même entité pour le calcul des limites décrites dans ce point 4.

Un seul et même compartiment peut investir cumulativement jusqu'à 20 % de ses actifs dans des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire d'un seul et même groupe.

5. Sans préjudice des limites prévues au point 8., les limites prévues au point 4. sont portées à un maximum de 20 % pour les investissements en actions et/ou titres de créance d'un seul et même émetteur lorsque la politique d'investissement du compartiment vise à reproduire la composition d'un indice actions ou obligataire spécifique qui est reconnu par la CSSF, sur les bases suivantes :

- la composition de l'indice est suffisamment diversifiée ;
- l'indice constitue un étalon représentatif du marché auquel il se réfère ;
- l'indice a fait l'objet d'une publication adéquate.

La limite stipulée dans la phrase précédente est portée à 35 % lorsque cela s'avère justifié par des conditions de marché exceptionnelles, notamment sur des marchés réglementés où certaines valeurs mobilières ou certains instruments du marché monétaire sont largement dominants. L'investissement jusqu'à cette limite n'est permis que pour un seul et même émetteur.

6. Nonobstant les limites indiquées au point 4, un compartiment peut investir, selon le principe de répartition des risques, jusqu'à 100 % de ses actifs dans différentes valeurs mobilières et différents instruments du marché monétaire émis ou garantis par un État membre de l'Union européenne, par une ou plusieurs de ses collectivités territoriales, par un autre État faisant partie de l'OCDE, par le Brésil, l'Indonésie, la Russie, Singapour et l'Afrique du Sud ou par un organisme public international dont font partie un ou plusieurs États membres de l'Union européenne.

Ces titres doivent provenir de six émissions différentes au minimum, mais les titres de toute émission individuelle ne devraient pas représenter plus de 30 % du total.

7.

- a) Un compartiment peut acquérir des parts ou actions d'OPCVM et/ou d'autres OPC mentionnés à la disposition 1.e) à condition de ne pas investir plus de 20 % de ses actifs dans un seul et même OPCVM ou autre OPC. Aux fins de l'application de cette limite d'investissement, chaque compartiment d'un OPCVM ou OPC à compartiments multiples sera considéré, comme défini par l'Article 181 de la Loi, comme un émetteur distinct, à condition que le principe de la séparation des engagements des différents compartiments à l'égard des tiers soit assuré.

- b) Les investissements dans des parts ou actions d'OPC autres que des OPCVM ne pourront pas dépasser au total 30 % des actifs d'un compartiment. Si un compartiment a acquis des parts ou actions d'OPCVM et/ou autres OPC, les actifs desdits OPCVM ou autres OPC ne doivent pas être combinés aux fins de l'application des limites prévues au point 4.

- c) Dû au fait que la Société puisse investir dans des parts ou actions d'OPC, l'investisseur risque de payer le double de commissions (par exemple, les commissions de gestion prélevées sur l'OPC dans laquelle la Société est investie).

Un compartiment ne peut investir dans un OPCVM ou autre OPC (sous-jacent) avec une commission de gestion supérieure à 3 % par an.

Lorsqu'un compartiment investit dans des OPCVM et/ou autres OPC qui sont gérés, de façon directe ou par délégation, par la même Société de gestion ou par toute autre société à laquelle la Société de gestion est liée dans le cadre d'une communauté de gestion ou de contrôle ou par une importante participation directe ou indirecte, le compartiment ne supportera aucune commission de souscription ou de rachat au titre des investissements des parts ou actions de ces actifs sous-jacents.

La commission de gestion annuelle maximale payable directement par les compartiments est définie dans le Livre II.

8.

- a) La Société ne peut acquérir d'actions assorties de droits de vote qui lui permettraient d'exercer une influence notable sur la gestion d'un émetteur.

- b) Par ailleurs, la Société ne peut acquérir plus de :

- 10 % d'actions non assorties de droits de vote d'un seul et même émetteur ;

- 10 % des titres de créance d'un seul et même émetteur ;
- 25 % de parts ou d'actions d'un seul et même OPCVM ou autre OPC, comme défini à l'Article 2, paragraphe 2 de la Loi ;
- 10 % d'instruments du marché monétaire émis par un seul et même émetteur.

Les limites stipulées aux deuxième, troisième et quatrième alinéas ci-dessus peuvent ne pas être respectées au moment de l'acquisition si, à ce moment-là, le montant brut des obligations ou des instruments du marché monétaire, ou le montant net des titres émis ne peut être calculé.

c) Les dispositions a) et b) ne s'appliquent pas au regard des :

- valeurs mobilières et instruments du marché monétaire émis ou garantis par un État membre de l'Union européenne ou ses collectivités territoriales ;
- valeurs mobilières et instruments du marché monétaire émis ou garantis par un État qui ne fait pas partie de l'Union européenne ;
- valeurs mobilières et instruments du marché monétaire émis par des organismes internationaux à vocation publique dont un ou plusieurs États membres de l'UE font partie ;
- actions détenues par la Société dans le capital d'une société constituée dans un État n'appartenant pas à l'Union européenne investissant ses actifs essentiellement en titres d'émetteurs situés dans ledit État lorsque, en vertu de la législation de celui-ci, une telle participation constitue pour la Société la seule possibilité d'investir en titres d'émetteurs situés dans cet État. Toutefois, cette dérogation n'est applicable que si, dans sa politique d'investissement la société située dans l'État non membre de l'Union européenne respecte les limites établies aux points 4., 7., 8.a) et 8.b). Si les limites stipulées aux points 4. et 7. sont franchies, le point 9. s'appliquera.

9. Les compartiments ne sont pas tenus de respecter les limites stipulées dans la présente Annexe lorsqu'ils exercent les droits de souscription sur des valeurs mobilières ou des instruments du marché monétaire formant partie de leurs actifs.

Tout en continuant de respecter le principe de diversification des risques, les compartiments nouvellement autorisés peuvent être dispensés des restrictions prévues aux points 4., 5., 6. et 7. pendant les six mois suivant la date de leur autorisation.

Si les limites stipulées au premier paragraphe sont dépassées accidentellement par le compartiment ou à la suite de l'exercice des droits de souscription, ce dernier doit, dans ses transactions de vente, avoir pour objectif prioritaire de régulariser cette situation dans le respect des intérêts des actionnaires.

10. Un compartiment peut acquérir des devises à travers un prêt face à face (back-to-back).

Un compartiment peut effectuer des emprunts de la manière suivante, sous réserve que ces emprunts soient :

- a) provisoires et représentent un maximum de 10 % de ses actifs ;
- b) permettent l'acquisition de biens immobiliers indispensables à l'exercice direct de ses activités et représentent une part maximale de 10 % de ses actifs.

Si un compartiment est autorisé à effectuer des emprunts en vertu des points a) et b), ceux-ci ne doivent pas excéder 15 % du total de ses actifs.

11. Sans préjudice de l'application des points 1., 2., 3., et de l'Annexe 2, un compartiment ne peut pas octroyer de crédit ou se porter garant pour le compte de tiers.

Le paragraphe précédent n'empêche pas un compartiment d'acquérir les valeurs mobilières, instruments du marché monétaire et autres instruments financiers spécifiés aux dispositions 1.e), g) et h) qui ne sont pas entièrement remboursés.

12. Un compartiment ne peut pas vendre à découvert les valeurs mobilières, instruments du marché monétaire et autres instruments financiers spécifiés aux dispositions 1.e), g) et h).

13. Par dérogation à la restriction ci-dessus, un compartiment désigné comme « **Fonds nourricier** » peut investir :

- a) au moins 85 % de ses actifs en parts ou actions d'un autre OPCVM ou d'un autre compartiment de l'OPCVM (le « **Fonds maître** ») ;
- b) jusqu'à 15 % de ses actifs dans une ou plusieurs des catégories d'actifs suivantes :
 - liquidités, à titre accessoire ;
 - instruments financiers dérivés, ne pouvant être utilisés qu'à des fins de couverture, conformément au point 1.g) et à l'Annexe 2 ;
 - biens mobiliers et immobiliers essentiels à la poursuite directe de son activité.

14. Un compartiment peut acquérir des actions d'un ou plusieurs autres compartiments de la Société (le compartiment cible), sous réserve que :

- le compartiment cible n'investisse pas, à son tour dans le compartiment ;
- la proportion des actifs que chaque compartiment cible investit dans d'autres compartiments cibles de la Société n'excède pas 10 % ;
- les droits de vote associés aux actions des compartiments cibles soient suspendus pendant toute la durée de leur détention par le compartiment, sans préjudice du traitement approprié dans les comptes et rapports périodiques ;
- dans tous les cas, la valeur de ces titres ne soit en aucun cas prise en compte pour le calcul des actifs nets de la Société, tant qu'ils sont détenus par cette dernière, aux fins de la vérification du seuil minimum d'actifs nets imposé par la Loi ; et que
- les commissions de gestion, de souscription ou de rachat ne soient pas dupliquées entre le compartiment qui a investi dans le compartiment cible et ce compartiment cible.

15. Tout compartiment de la Société ne peut investir plus de 20 % de ses actifs nets dans des titres adossés à des actifs (ABS, asset backed securities)/titres adossés à des crédits hypothécaires (MBS, mortgage backed securities).

16. Tout compartiment de la Société, dont la finalité est d'investir principalement en actions (à l'exception des compartiments « Profile ») ne sera pas exposé à des actifs non productifs et/ou des Actifs « distressed » (en difficulté).

17. Les compartiments de la Société non énumérés au point 16. ne seront pas directement exposés de manière active à des actifs non productifs. En cas d'exposition à un actif non productif, le Gestionnaire cherchera à vendre son exposition dans un délai raisonnable, en tenant compte notamment des conditions du marché et de l'intérêt des actionnaires.

18. Aucun compartiment de la Société ne sera directement exposé de manière active à des Obligations CoCo. En cas d'exposition à des Obligations CoCo, par exemple à la suite d'une opération sur titres, le Gestionnaire cherchera à vendre son exposition dans un délai raisonnable, en tenant compte notamment des conditions du marché.

En règle générale, le Conseil d'administration se réserve à tout moment le droit d'introduire d'autres restrictions d'investissement lorsque cela s'avère indispensable pour respecter les lois et réglementations en vigueur dans certains États où les actions de la Société peuvent être offertes et vendues. D'autre part, lorsque les réglementations en cours applicables à la Société le permettent, le Conseil d'administration se réserve le droit de dispenser un ou plusieurs compartiments d'une ou plusieurs restrictions d'investissement spécifiées

ci-dessus. Ces exceptions seront mentionnées dans les politiques d'investissement de tous les compartiments concernés résumées dans le Livre II.

ANNEXE 2 – TECHNIQUES, INSTRUMENTS FINANCIERS ET POLITIQUES D'INVESTISSEMENT

Sans préjudice de l'une quelconque des stipulations relatives à un ou plusieurs compartiments particuliers, la Société est autorisée, pour chaque compartiment, et conformément aux conditions énoncées ci-dessous, à recourir aux instruments financiers dérivés en vertu du point 1.g) de l'Annexe 1 du Prospectus.

Chaque compartiment peut, dans le cadre de sa politique d'investissement et dans les limites définies au point 1. de l'Annexe 1 du Prospectus, investir dans des instruments financiers dérivés à condition que l'exposition totale des actifs sous-jacents n'excède pas les limites d'investissement stipulées au point 4. de l'Annexe 1. Lorsqu'un compartiment investit dans des instruments financiers dérivés basés sur un **indice**, ces investissements ne s'inscrivent pas forcément dans les limites d'investissement stipulées au point 4. de l'Annexe 1 du Prospectus.

Lorsqu'il porte sur une valeur mobilière ou sur un instrument du marché monétaire, l'instrument dérivé doit être pris en compte dans les présentes dispositions.

1. Informations d'ordre général

La Société peut utiliser des instruments dérivés dont les actifs sous-jacents sont des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire, tant à des fins de couverture que d'investissement.

Si les transactions susmentionnées impliquent l'utilisation d'instruments dérivés, les présentes conditions et limites doivent correspondre aux dispositions prévues à l'Annexe 1 du Prospectus.

Un compartiment qui utilise des instruments dérivés à des fins d'investissement ne pourra le faire que dans les limites posées dans sa politique d'investissement.

1.1. Détermination de l'exposition globale

Conformément à la Circulaire 11/512, la Société de gestion doit calculer l'exposition globale du compartiment au moins une fois par jour. Ces limites relatives à l'exposition globale doivent être continuellement respectées.

Il incombe à la Société de gestion de choisir la méthode de calcul appropriée. Plus particulièrement, ce choix doit se fonder sur l'étude, faite par la Société de gestion elle-même, du profil de risque du compartiment résultant de sa politique d'investissement (notamment de l'utilisation des instruments financiers dérivés).

1.2. Méthode d'évaluation du risque en fonction du profil de risque du compartiment

Les compartiments sont classés après étude de leur profil de risque induit par leur politique d'investissement, notamment leur stratégie d'investissement en dérivés inhérente, qui s'effectue selon les deux méthodes d'évaluation de risque suivantes :

- La méthode avancée d'évaluation du risque telle que l'approche de la VaR visant à calculer l'exposition globale :
 - (a) Le compartiment adopte des stratégies d'investissement complexes qui représentent une part non négligeable de sa politique d'investissement ;
 - (b) Le compartiment détient une exposition non négligeable à des dérivés particuliers ; ou
 - (c) L'approche par les engagements ne permet pas de mesurer adéquatement le risque de marché du portefeuille.

Les compartiments dont l'exposition est mesurée par la VaR sont indiqués au point 1.5

- La méthode de calcul de l'exposition globale selon les engagements doit être utilisée dans tous les autres cas de figure.

1.3. Calcul de l'exposition globale

1.3.1. Pour les compartiments utilisant l'approche par les engagements :

- La méthode de conversion employée pour les **dérivés standards** se base toujours sur la valeur de marché de la position équivalente de l'actif sous-jacent. Elle peut être remplacée par la valeur notionnelle ou par le prix des contrats à terme standardisés (futures) lorsque celui-ci est plus prudent.
- Pour les **dérivés non normalisés**, une approche alternative peut être utilisée à condition que le montant des dérivés représente une part négligeable du portefeuille du compartiment
- Pour les **compartiments structurés**, la méthode de calcul est décrite dans les lignes d'orientation de l'AEMF/2012/197

La méthode de calcul des engagements ne prend pas en compte les instruments financiers dérivés qui réunissent les deux conditions suivantes :

- (a) La position du compartiment portant à la fois sur un instrument financier dérivé lié à un actif financier et des liquidités investis dans des actifs sans risque est équivalente à une position en numéraire sur l'actif financier considéré.
- (b) L'instrument financier dérivé n'est pas censé générer une exposition et un effet de levier ou risque de marché supplémentaire.

L'engagement total du compartiment lié aux instruments financiers dérivés, limité à 100 % de la valeur nette d'inventaire du compartiment, est alors quantifié sous la forme d'une somme, en valeur absolue, des engagements individuels, après prise en compte des opérations éventuelles de compensation et de couverture.

1.3.2. Pour les compartiments ayant recours à l'approche « VaR », l'exposition globale est déterminée quotidiennement en mesurant la perte potentielle maximale à un niveau de confiance donné sur une période spécifique dans des conditions de marché normales.

Selon son profil de risque et sa stratégie d'investissement, le compartiment peut utiliser l'approche de la VaR relative ou l'approche de la VaR absolue :

- **L'approche de la VaR relative** consiste à définir librement un portefeuille de référence sans effet de levier reflétant la stratégie d'investissement du compartiment ; la VaR du compartiment ne peut pas excéder le double de la VaR du portefeuille de référence.
- **L'approche de la VaR absolue** concerne les compartiments qui investissent dans des catégories multi-actifs et qui n'ont pas d'objectif d'investissement défini en rapport à un indice de référence, mais qui visent plutôt un objectif de rendement absolu ; le niveau de VaR absolue est strictement limité à 20 %.

Les **limites de la VaR** doivent toujours être établies selon le profil de risque défini.

Le calcul de la VaR doit s'effectuer sur la base des paramètres suivants : un niveau de confiance de 99 %, une période de détention de 1 mois (20 jours) et une période d'observation historique des facteurs de risque d'au moins un an (250 jours).

La Société de gestion réalise un programme mensuel de **tests a posteriori** et rapporte trimestriellement à l'équipe dirigeante le nombre de dépassements.

La Société de gestion réalise des **tests de résistance** mensuels afin de faciliter la gestion des risques associés à des éventuels mouvements anormaux du marché.

1.4. Liste des compartiments utilisant l'approche par les engagements pour le calcul de l'exposition globale et de leur portefeuille de référence.

Grâce à l'application de l'approche par les engagements telle que décrite au point 1.3.1 ci-dessus, l'exposition globale de chaque compartiment n'excèdera pas la valeur nette d'inventaire de son portefeuille.

Nonobstant ce qui précède, et à des fins supplémentaires d'information, l'exposition calculée (i) sur la base de la somme de la valeur absolue des montants notionnels des dérivés et des investissements en valeurs mobilières (y compris les positions de liquidités sans opérations de compensation/couverture) impliquant que les expositions directes et indirectes doivent être prises en compte dans le calcul de l'exposition totale et (ii) divisée par la VNI totale du compartiment est indiquée dans le tableau ci-dessous :

| Compartiment | Portefeuille de référence* | Exposition prévue | Exposition maximum |
|--|---|--------------------------|---------------------------|
| Aegon Global Impact Equities | MSCI World TR Net | 100 % | 120 % |
| Amundi European ESG Equities | MSCI Europe TR Net | 100 % | 120 % |
| Aristotle US Equities | MSCI USA TR Net | 100 % | 120 % |
| Baring Emerging Markets ESG Bonds | 50 % JP Morgan EMBI Global Diversified composite EUR + 50 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified composite EUR | 150 % | 400 % |
| Blackrock Euro Government ESG Bonds | Bloomberg Euro Treasury 1-10 Year | 125 % | 200 % |
| Boston Common US Sustainable Equities | MSCI USA TR Net | 100 % | 120 % |
| Boston Common Emerging Markets ESG Equities | MSCI Emerging Markets TR Net | 100 % | 120 % |
| Boston Trust Walden US ESG Equities | MSCI USA Value TR Net | 100 % | 120 % |
| Candriam Emerging Markets ESG Bonds | 50 % JP Morgan EMBI Global Diversified EUR + 50 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified EUR | 150 % | 400 % |
| Candriam Euro ESG Short Term Bonds | Euribor 3 Months | 125 % | 200 % |
| Candriam European ESG Convertibles | Thomson Reuters Europe Focus Hedged Convertible Bond (EUR) | 125 % | 200 % |
| Candriam European ESG Smaller Companies Equities | MSCI European Small Cap TR Net | 100 % | 120 % |
| Candriam European ESG Equities | MSCI Europe TR Net | 100 % | 120 % |
| Candriam French ESG Equities | MSCI France TR Net | 100 % | 120 % |
| Candriam Global ESG Convertibles | Thomson Reuters Global Focus Hedged Convertible Bond (EUR) | 125 % | 200 % |
| Candriam Global Dividend Equities | MSCI AC World TR Net | 100 % | 120 % |
| Candriam Global ESG High Yield Bonds | Bloomberg Global High Yield Corporate EUR hedged | 150 % | 400 % |
| Candriam Total Return Global Bonds | ICE BofAML Euro Corporate | 150 % | 200 % |
| Candriam Total Return Global Equities | 50 % MSCI World TR Net + 25 % ICE BofAML 1-10 Year Euro Government + 25 % €STR Capitalised | 125 % | 200 % |
| EdenTree European Sustainable Equities | MSCI Europe TR Net | 100 % | 120 % |
| Emerging Markets ESG Equities | MSCI Emerging Markets TR Net | 100 % | 120 % |
| Global ESG Equities | MSCI World TR Net | 100 % | 120 % |
| Impax US ESG Equities | MSCI USA TR Net | 100 % | 120 % |
| Insight Euro Aggregate Bonds | Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year | 125 % | 200 % |
| Insight Euro ESG Corporate Bonds | Bloomberg Euro Aggregate Corporate | 125 % | 200 % |
| Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged | ICE BofAML Duration Hedged Euro Corporate | 300 % | 400 % |
| JPMorgan Asia Pacific ESG Equities | MSCI Pacific net Total Return USD | 100 % | 120 % |
| Kempen Euro Corporate Bonds | Bloomberg Euro Aggregate Corporate | 125 % | 200 % |
| Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged | ICE BofAML Duration Hedged Euro Corporate | 300 % | 400 % |
| Liontrust European Sustainable Equities | MSCI Europe TR Net | 100 % | 120 % |
| Liontrust Global Impact Equities | MSCI World TR Net | 100 % | 120 % |

| Compartiment | Portefeuille de référence* | Exposition prévue | Exposition maximum |
|---|---|--------------------------|---------------------------|
| M&G Emerging Markets Equities | MSCI Emerging Markets TR Net | 100 % | 120 % |
| Numeric Emerging Markets Equities | MSCI Emerging Markets TR Net | 100 % | 120 % |
| Parnassus US ESG Equities | MSCI USA TR Net | 100 % | 120 % |
| Portfolio High Quality Impact Bonds | Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year excluding Corporates and Securitized Index | 125 % | 200 % |
| Private Portfolio Bonds | Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year | 120 % | 150 % |
| Private Portfolio Equities | 50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10 % MSCI EM TR Net | 100 % | 120 % |
| Putnam US ESG Equities | MSCI USA Growth TR Net | 100 % | 120 % |
| Pzena European Equities | MSCI Europe TR Net | 100 % | 120 % |
| Pzena US Equities | MSCI USA TR Net | 100 % | 120 % |
| Robeco Euro ESG Government-Related Bonds | Bloomberg Euro Government Related 1-10 Year | 125 % | 200 % |
| Sands Emerging Markets Equities | MSCI Emerging Markets TR Net | 100 % | 120 % |
| Schroder Euro Corporate ESG Bonds | Bloomberg Euro Aggregate Corporate | 125 % | 200 % |
| Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged | ICE BofAML Duration Hedged Euro Corporate | 300 % | 400 % |
| Walter Scott European ESG Equities | MSCI Europe TR Net | 100 % | 120 % |
| FoM Pacific Equities | MSCI Pacific TR Net | 105 % | 120 % |
| FoM Emerging Market Equities | MSCI Emerging Markets TR Net | 105 % | 120 % |
| FoM Euro Corporate Bonds | Bloomberg Euro Aggregate Corporate | 125 % | 200 % |
| FoM Euro Corporate Bonds Duration Hedged | ICE BofAML Duration Hedged Euro Corporate | 300 % | 400 % |
| FoM North American Equities | MSCI USA TR Net | 105 % | 120 % |
| Portfolio Flexible Bonds | 50 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 25 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR + 25 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR | 150 % | 400 % |
| Portfolio Flexible ESG Bonds | 50 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 25 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR + 25 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR | 150 % | 400 % |
| ESG Profile 1 – Very Defensive | 80 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % Euribor 1 month Capitalized | 200 % | 350 % |
| ESG Profile 2 – Defensive | 20 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10% MSCI EM TR Net) + 60 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % Euribor 1 month Capitalized | 175 % | 300 % |
| ESG Profile 3 – Moderately Defensive | 35 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10% MSCI EM TR Net) + 45 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % Euribor 1 month Capitalized | 175 % | 250 % |

| Compartiment | Portefeuille de référence* | Exposition prévue | Exposition maximum |
|--|--|--------------------------|---------------------------|
| ESG Profile 4 – Moderately Aggressive | 55 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10% MSCI EM TR Net) + 25 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % Euribor 1 month Capitalized | 150 % | 225 % |
| ESG Profile 5 – Aggressive | 75 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10% MSCI EM TR Net) + 5 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % Euribor 1 month Capitalized | 125 % | 175 % |
| ESG Profile 6 – Very Aggressive | 90 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10 % MSCI EM TR Net) + 10 % Euribor 1 month Capitalized | 105 % | 120 % |
| Comfort Invest II | 20 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10% MSCI EM TR Net) + 60 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % Euribor 1 month Capitalized | 125 % | 200 % |
| Comfort Invest III | 35 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10% MSCI EM TR Net) + 45 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % Euribor 1 month Capitalized | 115 % | 150 % |
| Comfort Invest IV | 55 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10% MSCI EM TR Net) + 25 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % Euribor 1 month Capitalized | 115 % | 150 % |
| Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Defensief | 80 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % Euribor 1 month Capitalized | 125 % | 200 % |
| Verzekeringen Beleggingsfonds Defensief | 20 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10% MSCI EM TR Net) + 60 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % Euribor 1 month Capitalized | 125 % | 200 % |

| Compartiment | Portefeuille de référence* | Exposition prévue | Exposition maximum |
|---|---|--------------------------|---------------------------|
| Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Defensief | 35 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10% MSCI EM TR Net) + 45 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % Euribor 1 month Capitalized | 125 % | 175 % |
| Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Offensief | 55 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10% MSCI EM TR Net) + 25 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % Euribor 1 month Capitalized | 115 % | 150 % |
| Verzekeringen Beleggingsfonds Offensief | 75 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10% MSCI EM TR Net) + 5 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % Euribor 1 month Capitalized | 110 % | 135 % |
| Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Offensief | 90 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10 % MSCI EM TR Net) + 10 % Euribor 1 month Capitalized | 105 % | 120 % |
| Global Balanced | 55 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10% MSCI EM TR Net) + 25 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % Euribor 1 month Capitalized | 120 % | 150 % |
| Flexible Allocation Fund | 35 % * (50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10% MSCI EM TR Net) + 45 % Bloomberg Euro Aggregate TR Index 1-10 Year + 5 % Bloomberg Global High Yield Corporate EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan EMBI Global Diversified Composite EUR Hedged + 2,5 % JP Morgan CEMBI Broad Diversified Composite EUR Hedged + 10 % Euribor 1 month Capitalized | 100 % | 120 % |
| Portfolio Global Equities | 50 % MSCI Europe TR Net + 40 % MSCI World ex Europe TR Net + 10 % MSCI Emerging Markets TR Net | 105 % | 120 % |
| Portfolio Global ESG Equities | MSCI All Countries World TR Net | 105 % | 120 % |
| Portfolio High Quality Bonds | Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year | 125 % | 200 % |
| Portfolio High Quality ESG Bonds | Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year | 125 % | 200 % |

* il est porté à l'attention des investisseurs que si, pour chaque compartiment du Livre II, le portefeuille dudit compartiment est construit et géré sans prendre en compte le Portefeuille de référence susmentionné, il ne devrait y avoir aucune incidence au sens de l'Article 7(1)(d) du Règlement (UE) 583/2010 du 1^{er} juillet 2010.

1.5. Liste des compartiments utilisant l'approche de la VaR pour le calcul de l'exposition globale, leur portefeuille de référence (le cas échéant) et les effets de levier

L'effet de levier prévu est défini comme la somme de la valeur absolue des montants notionnels des dérivés (sans opérations de compensation/couverture)/VNI (méthode des montants notionnels).

Des niveaux de levier plus élevés peuvent être mentionnés dans le prospectus : un ratio de levier maximum (méthode des montants notionnels et méthode des engagements) pouvant être atteint durant la durée de vie du compartiment eu égard à sa politique d'investissement.

| Compartiment | Approche VaR | Portefeuille de référence* | Effet de levier prévu | Effet de levier maximum |
|--------------------------------------|---------------------|------------------------------------|------------------------------|--------------------------------|
| RBC BlueBay Euro Government Bonds | Relative | Bloomberg Euro Treasury 1-10 Year | 300 % | 1500 % |
| RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds | Relative | Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year | 300 % | 1500 % |

* il est porté à l'attention des investisseurs que si, pour chaque compartiment du Livre II, le portefeuille dudit compartiment est construit et géré sans prendre en compte le portefeuille de référence susmentionné, il ne devrait y avoir aucune incidence au sens de l'Article 7(1)(d) du Règlement (UE) 583/2010 du 1^{er} juillet 2010.

1.6. Calcul du risque de contrepartie lié aux instruments dérivés négociés de gré à gré

Conformément au point 4.a) de l'Annexe 1 du Prospectus, le risque de contrepartie lié aux dérivés négociés de gré à gré par un compartiment ne peut excéder 10 % de ses actifs lorsque la contrepartie est un établissement de crédit mentionné à la disposition 1.f) de l'Annexe 1 du Prospectus ou 5 % de ses actifs dans les autres cas.

Le risque de contrepartie lié aux dérivés négociés de gré à gré doit se baser sur la valeur positive du contrat par référence au marché.

1.7. Valorisation des dérivés négociés de gré à gré

Conformément au point 1.g) de l'Annexe 1 du Prospectus, la Société de gestion doit établir, documenter, mettre en œuvre et maintenir des accords et procédures permettant une valorisation adéquate, transparente et juste des dérivés négociés de gré à gré.

1.8. Méthode de calcul du risque de marché total pour les compartiments Nourriciers

L'exposition globale d'un compartiment Nourricier sera calculée en combinant sa propre exposition à travers les instruments financiers dérivés, avec soit :

- a) l'exposition actuelle du compartiment Maître à travers les instruments financiers dérivés au prorata de l'investissement du compartiment Nourricier dans le compartiment Maître ; ou
- b) l'exposition totale potentielle maximale du compartiment Maître liée aux instruments financiers dérivés telle que définie dans les règles de gestion prévues par les Statuts au prorata de l'investissement du compartiment Nourricier dans le compartiment Maître.

2. Dispositions concernant les instruments spécifiques

Lorsqu'elle achète ou vend des swaps (contrats d'échange) de défaut de crédit (**CDS**, credit default swap), la Société se couvre contre le risque de défaut d'un émetteur en payant une prime trimestrielle. En cas de défaut de paiement, le règlement du contrat peut se faire soit en numéraire, auquel cas l'acheteur de la protection reçoit la différence entre la valeur nominale et la valeur recouvrable, ou sous forme d'un règlement en nature, auquel cas l'acheteur de la protection vend le titre ayant fait l'objet du défaut de paiement, ou tout autre titre sélectionné parmi un panier de titres livrables convenu dans le contrat CDS, au vendeur de la protection et récupère le montant de la valeur nominale. Les événements qui constituent une situation de défaut sont définis dans le contrat CDS, tout comme les procédures de livraison des obligations et certificats de dette. Lorsqu'elle achète un swap de défaut d'action (**EDS**, equity default swap), la Société se couvre contre le risque d'une forte baisse (la norme actuelle du marché étant de 70 %) de la valeur du titre sous-jacent sur le marché d'actions, indépendamment de la cause de la baisse, en payant une prime trimestrielle. Si le risque se matérialise, c.-à-d. si le prix de clôture sur le marché boursier atteint ou dépasse le seuil (-70 %), le paiement se règle en numéraire : l'acheteur de la protection reçoit un pourcentage prédéfini (la norme actuelle du marché européen est de 50 %) du montant notionnel initialement garanti. La Société peut également vendre le contrat EDS et assumer ainsi le risque de chute du cours de marché en échange d'une prime trimestrielle.

La Société peut uniquement négocier avec des établissements financiers de premier rang qui participent régulièrement à ces marchés et sont spécialisés dans ce type de transactions.

L'utilisation de CDS et EDS à des fins autres que de couverture doit satisfaire aux conditions suivantes :

- (a) elle doit se faire exclusivement dans l'intérêt des actionnaires et dans le but de générer un rendement intéressant par rapport aux risques encourus ;
- (b) les restrictions générales d'investissement définies à l'Annexe 1 s'appliquent à l'émetteur des CDS et EDS et au degré de risque lié au débiteur final desdits contrats ;
- (c) l'utilisation des CDS et EDS est cohérente avec les profils d'investissement et de risque des compartiments concernés ;
- (d) chaque compartiment doit s'assurer qu'il dispose de la couverture adéquate permanente des risques associés aux CDS et EDS de manière à pouvoir honorer les demandes de rachat des actionnaires ; et
- (e) les CDS et EDS sélectionnés sont suffisamment liquides pour permettre aux compartiments concernés de les vendre/dénouer aux prix théoriques déterminés.

Les obligations à moyen terme en euros (**EMTN**, **Euro Medium Term Notes**) sont des titres de créance à moyen terme caractérisés par leur degré élevé de flexibilité tant pour l'émetteur (du secteur privé ou public) que pour l'investisseur. Les EMTN sont émises selon le programme EMTN, à savoir que le financement de la dette peut être échelonné et que les montants impliqués peuvent varier. L'organisateur de l'émission ne sera pas nécessairement celui qui la souscrit, ce qui signifie que l'émetteur ne peut être certain de lever le montant intégral envisagé (il est donc dans l'intérêt de l'émetteur d'être doté d'une bonne notation de crédit).

Une EMTN structurée est un instrument combinant l'émission d'une EMTN avec un dérivé permettant la conversion des flux de trésorerie générés par l'EMTN. Par exemple, si l'émetteur lance une EMTN au taux variable LIBOR + prime et conclut simultanément un swap LIBOR/taux fixe sur la même période, il obtient l'équivalent d'un financement à taux fixe, tandis que l'investisseur obtient un investissement à taux variable. Ces EMTN structurées peuvent être souscrites par des fonds de placement cherchant à offrir à leurs clients des produits personnalisés qui répondent à leurs besoins spécifiques en termes de profils de risques.

Les **Produits négociés en bourse (ETP, Exchange Traded Products)** recouvrent sous ce terme général les Fonds négociés en bourse (ETF, Exchange Traded Funds), les Fonds de matières premières négociés en bourse (ETC, Exchange Traded Commodities), les Fonds d'obligations négociés en bourse (ETN, Exchange Traded Notes) ainsi que les fiducies cédantes américaines et autres fiducies réglementaires. Ce sont des titres à capital variable garantis ou non cotés sur une bourse de valeur et répliquant un actif sous-jacent.

Les **ETP liés aux matières premières** font référence à tous les produits négociés en bourse répliquant les rendements des matières premières. Ils n'incluent pas les ETP qui répliquent les rendements des actions de sociétés impliquées dans le secteur des matières premières.

Les **ETF** font référence aux produits négociés en bourse qui sont structurés et réglementés comme des fonds de placement ou des organismes de placement collectif :

- **États-Unis** : les ETF sont enregistrés en vertu de la Loi sur les Sociétés d'investissement de 1940. Actuellement, les ETF américains se fondent sur la livraison physique des actifs sous-jacents pour la création et le rachat de titres ;

- **Union européenne** : la majorité des ETF sont des OPCVM conformes aux organismes de placement collectif. Les fonds de type OPCVM ne sont pas autorisés à investir dans des matières premières physiques, mais peuvent avoir recours à leur réplique synthétique pour obtenir une exposition aux indices généraux de matières premières satisfaisant les exigences pertinentes en matière de diversification ;
- **Autres juridictions** : comme la Suisse, les autres juridictions permettent aux ETF d'avoir recours à la réplique physique ou réplique synthétique pour obtenir une exposition aux matières premières sans contrainte de diversification.

Les **ETC** se négocient et se règlent comme des ETF, mais sont structurés comme des instruments de créance. Ils répliquent les rendements d'un indice composé d'une seule ou de plusieurs matières premières. Les ETC détiennent physiquement la matière première sous-jacente (par exemple, l'or physique) ou obtiennent leur exposition à travers des swaps entièrement garantis.

Les **ETN** sont semblables aux ETC hormis le fait qu'ils ne sont pas garantis, ce qui signifie que l'investisseur d'un ETN est entièrement exposé au risque de crédit de l'émetteur.

- **États-Unis** : publication quotidienne des informations relatives à la VNI, du montant d'actifs sous gestion et des actions en circulation
- **Europe** : la publication quotidienne des informations relatives à la VNI, du montant d'actifs sous gestion et des actions en circulation n'est pas obligatoire et n'est pas non plus courante.

Les compartiments « actions » peuvent investir leurs actifs dans des actions et titres équivalents. Les titres équivalents aux actions incluent notamment les **ADR** et **GDR**, les certificats d'investissement, les bons de souscription et tout autre titre spécifié dans la politique d'investissement.

Les ADR/GDR regroupent toutes les catégories de certificats de dépôt américains et de certificats de dépôt internationaux, des certificats substituant les actions ne pouvant pas être achetées localement pour des raisons légales. Les ADR et les GDR ne sont pas cotés localement, mais sur des marchés comme New York et Londres et sont émis par des banques et/ou des établissements financiers importants situés dans des pays industrialisés en contrepartie de dépôts de titres comme mentionné dans les politiques d'investissement respectives du compartiment.

3. Techniques de gestion efficace de portefeuille

Actuellement, la Société n'utilise pas de telles techniques, et n'effectue pas, en particulier, d'opérations de prêt de titres. Au besoin, la Société actualisera son Prospectus au regard de ces techniques afin de respecter les règles établies par le Règlement (UE) 2015/2365 du 25 novembre 2015 relatif à la transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation et modifiant le Règlement (UE) n° 648/2012 et la Circulaire 14/592 de la CSSF sur les orientations de l'AEMF concernant les fonds négociés en bourse et autres questions liées aux OPCVM.

Lorsque la Société conclut des contrats de dérivés financiers négociés de gré à gré, elle garantira que la sûreté utilisée pour réduire l'exposition au risque de contrepartie satisfait à tout moment les critères suivants :

- Liquidité – Toute sûreté reçue autrement qu'en espèces devra être hautement liquide et négociée sur un marché réglementé ou sur une plateforme de négociation multilatérale à tarification transparente, afin de pouvoir être vendue rapidement à un prix proche de son évaluation avant la mise en vente. La sûreté reçue doit aussi respecter les dispositions de l'Article 56 de la Directive 2009/65/EC.
- Valorisation – Toute sûreté reçue doit être valorisée au moins quotidiennement et les actifs dont les cours présentent une volatilité élevée ne doivent pas être acceptés en tant que garantie à moins qu'une décote conservatrice adéquate de ces actifs ne soit mise en place.
- Qualité de l'émetteur de crédit – La sûreté reçue doit être de qualité supérieure.
- Corrélation – Toute sûreté reçue par la Société doit être émise par une entité qui est indépendante de la contrepartie et qui n'est pas supposée afficher un niveau de corrélation élevé avec la performance de la contrepartie.
- Diversification des actifs composant la sûreté – Les actifs composant la sûreté doivent être suffisamment diversifiés en termes de pays, marchés et émetteurs. Le critère de diversification suffisante eu égard à la concentration des émetteurs sera considéré comme respecté si la Société reçoit de la contrepartie de transactions réalisées à des fins de gestion efficace de portefeuille ou de transactions de gré à gré de dérivés financiers un panier de sûretés présentant une exposition maximale à un émetteur donné de 20 % de sa VNI. Lorsque la Société est exposée à différentes contreparties, les différents paniers de sûreté seront cumulés pour calculer la limite d'exposition de 20 % à un seul émetteur. Par dérogation au présent sous-paragraphe, la Société peut être intégralement garantie avec différentes valeurs mobilières et instruments du marché monétaire émis ou garantis par un État membre, une ou plusieurs de ses collectivités territoriales, un pays tiers ou un organe international public à qui un ou plusieurs États membres appartiennent. Dans ce cas, la Société devrait recevoir des titres de six émissions différentes au minimum, mais les titres de toute émission individuelle ne devraient pas représenter plus de 30 % de la VNI de la Société. Si elle prévoit d'être intégralement garantie avec des titres émis ou garantis par un État membre, la Société doit le stipuler dans le Prospectus. La Société devra également identifier dans son Prospectus, les États membres, les collectivités territoriales ou les organismes publics internationaux qui émettent ou garantissent des titres susceptibles d'être acceptés comme sûreté pour plus de 20 % de sa VNI.
- Les risques liés à la gestion des sûretés, tels que les risques opérationnels et les risques juridiques, doivent être identifiés, gérés et modérés par le biais du processus de gestion des risques de la Société de gestion.
- Lors d'un transfert de titre, la sûreté reçue sera conservée par le Dépositaire. Eu égard à tous autres types d'accords de sûreté, la sûreté peut être détenue par un dépositaire tiers, lequel est soumis à une surveillance prudentielle, et ne présente aucun lien avec le fournisseur de la sûreté.
- Une sûreté reçue doit pouvoir être entièrement réalisée à tout moment par la Société sans information ni approbation de la contrepartie.
- La sûreté non numéraire reçue ne doit pas être vendue, réinvestie ni nantie.
- La sûreté en numéraire reçue doit être uniquement :
 - placée sur des dépôts auprès d'entités comme prescrit dans l'Article 50(f) de la Directive 2009/65/CE ;
 - investie dans des obligations d'État de qualité élevée ;
 - utilisée aux fins de contrats de prise en pension à condition que les transactions soient réalisées avec des établissements de crédit soumis à un contrôle prudentiel et que la Société puisse restituer à tout moment le montant intégral des espèces selon la méthode de la comptabilité d'exercice ;
 - investie dans des fonds du marché monétaire.

Dans ce cas, la Société mettra en place une politique claire de décote adaptée à chaque catégorie d'actifs reçue en tant que sûreté, en tenant compte, à l'heure d'appliquer ladite politique, des caractéristiques des actifs telles que la notation de crédit et/ou la volatilité des cours, ainsi que des résultats des tests de résistance. La Société garantira que chaque décision d'appliquer ou de ne pas appliquer une

décote particulière à une certaine catégorie d'actifs doit être justifiée et documentée sur la base de cette politique. La sûreté et les politiques de décote de la Société seront divulguées dans le Prospectus.

4. Processus de sélection des investissements en fonction des critères ESG/de durabilité

Conformément aux Principes pour l'investissement responsable des Nations Unies, la Société de gestion exclut tout investissement direct dans des titres émis par des sociétés impliquées dans des activités hautement controversées (telles que la production de tabac et d'armes controversées) et en violation grave des Principes du Pacte mondial des Nations Unies (sociétés non conformes). Cette règle d'exclusion considérée comme une garantie E/S et comme une pratique de bonne gouvernance s'applique à tous les compartiments (y compris les compartiments qui ne sont pas des produits d'investissement relevant de l'article 8 ou 9 du SFDR) et à leurs investissements directs.

Les compartiments classés comme relevant de l'article 8 ou 9 du SFDR appliquent, en plus des principes pour l'investissement responsable et du Pacte mondial des Nations Unies, une approche environnementale, sociale et de gouvernance fondée sur la combinaison de règles d'exclusion, de filtres ESG et d'actions d'engagement (le cas échéant) :

La Société de gestion a défini différents niveaux d'engagement ESG comme suit :

| Catégorie SFDR | Catégorie interne | Niveau d'engagement ESG |
|----------------|-------------------|-------------------------|
| Art.9 | Art.9 | Fort |
| Art.8 | Art.8+ | Fort |
| Art.8 | Art.8 | Moyen |
| Art.6 | Art.6 | Faible/Aucun |

La Société de gestion a défini différents ensembles d'exclusions s'appliquant aux investissements directs, comme suit :

ENTREPRISES

| Activité/secteur exclus ¹ | Seuil de chiffre d'affaires | Art.6 | Art.8 | Art.8+ | Art.9 ² |
|---|--|-------|-------|--------|--------------------|
| Armes controversées | 0% | X | X | X | X |
| Pacte mondial des Nations Unies, sociétés non conformes | Aucune tolérance | X | X | X | X |
| Production d'armes – contrats militaires (armement) - Armes de petit calibre à usage militaire ou civil | 0 % à l'exception des contrats militaires et des produits et/ou services liés aux armes (seuil : 5 %) | - | - | X | X |
| Production de tabac (producteurs et fabricants) | 0% | X | X | X | X |
| Jeux de hasard | 5% | - | - | X | X |
| Divertissement pour adultes (ex. pornographie) | 5% | - | - | X | X |
| Produits en fourrure et en cuir d'animaux | 5% | - | - | X | X |
| Plantes et semences OGM | 5% | - | - | X | X |
| Tests sur les animaux | Évaluation qualitative (s'assurer que les pratiques exigées par la loi répondent aux normes moyennes du secteur) | - | - | X | X |
| Cannabis à des fins récréatives | 5% | - | - | X | X |
| Forages dans l'Arctique et méthodes d'extraction du gaz et des sables bitumineux | 5% | - | - | X | X |
| Production/extraction de charbon thermique | 5% | - | - | X | X |
| | 10% | - | X | - | - |
| Production d'énergie au charbon thermique | 10% | - | X | X | X |
| Commerce et/ou vente en gros du tabac (y compris le commerce de détail) | 50% | - | - | X | X |

1) La liste des exclusions et le seuil de chiffre d'affaires peuvent évoluer

2) Certains compartiments (Art.9) peuvent s'écarter intentionnellement des règles d'exclusion.

| Couverture minimale de l'analyse de durabilité | Art.6 | Art.8 | Art.8+ | Art.9 |
|--|----------------|-------|--------|-------|
| % des titres en portefeuille (*) | Pas de minimum | 70% | 90% | 90% |

(*) la trésorerie, les dépôts et les instruments dérivés sont exclus

En outre, les fonds relevant de l'article 8 visent à obtenir un score ESG du portefeuille supérieur au score ESG de l'univers d'investissement/de l'indice de référence.

| Exclusions fondées sur les normes | | Art.6 | Art.8 | Art.8+ | Art.9 |
|--|---|-------|-------|--------|-------|
| Pays en violation des normes internationales et soumis à des sanctions internationales | | X | X | X | X |
| Pays qui n'ont pas ratifié les traités suivants | Le Traité sur la non-prolifération des armes nucléaires | - | X | X | X |
| | L'Accord de Paris sur le climat (2015) | - | X | X | X |
| | La Convention 182 de l'OIT sur le travail des enfants | - | X | X | X |

Les ensembles d'exclusions peuvent évoluer au fil du temps (sans aucun préavis) et les produits d'investissement peuvent prendre en compte des seuils plus stricts et/ou des exclusions supplémentaires. La dernière version de la politique d'investissement durable de la Société de gestion est disponible sur son site Internet.

La classification des compartiments, basée sur la propre évaluation de la Société de gestion, est résumée dans un tableau dédié à la dernière page du Prospectus.

Intégration des risques de durabilité dans le processus d'investissement

S'agissant de l'intégration des Risques de durabilité dans les décisions d'investissement des compartiments, la Société de gestion fait la distinction entre l'ensemble des exclusions et l'intégration des questions ESG, ainsi que les approches individualisées des Gestionnaires d'investissement externes de certains compartiments.

Pour chaque compartiment relevant de l'article 8 ou 9, une section spéciale du Prospectus présente la méthode selon laquelle le gestionnaire du compartiment tient compte des risques de durabilité dans ses décisions d'investissement. Les compartiments relevant de l'article 8 ou 9 prennent en compte le Risque de durabilité tel que défini par la Société de gestion et peuvent utiliser des filtres supplémentaires du gestionnaire d'investissement.

Les compartiments relevant de l'article 6 prennent en compte les risques de durabilité dans la mesure où ils mettent en œuvre les règles d'exclusion minimale de la Société de gestion (en empêchant l'investissement dans les entreprises qui ont les plus mauvaises pratiques en matière de gouvernance, d'environnement, de questions sociales, de droits de l'homme et d'activités controversées considérées comme ayant un impact négatif significatif en matière de durabilité) ; les investissements sous-jacents des compartiments relevant de l'article 6 du SFDR ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Engagement : désigne la responsabilité du gestionnaire de portefeuille, les objectifs d'engagement spécifiques dépendant de la stratégie d'investissement du compartiment et du rôle des critères ESG. Un compartiment qui souhaite contribuer à la réduction des gaz à effet de serre peut s'engager d'une manière différente à travers les participations de son portefeuille de celle d'un compartiment qui se concentre sur les droits de l'homme. En outre, un compartiment qui a une approche orientée sur la valeur peut s'engager d'une manière différente de celle d'un compartiment qui a une approche orientée croissance. Les Gestionnaires d'investissement rendent compte de leurs efforts d'engagement à la Société de gestion tous les ans.

Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité : Suite à l'entrée en vigueur du Règlement (UE) 2022/1288 du 6 avril 2022 complétant le SFDR en ce qui concerne les normes techniques de réglementation, la Société de gestion divulguera les informations :

- précisant le contenu et la présentation des informations relatives à la promotion de caractéristiques environnementales ou sociales et/ou d'objectifs d'investissement durable
 - précisant le contenu, les méthodes et la présentation pour les informations relatives aux indicateurs de durabilité et aux incidences négatives en matière de durabilité,
 - en ce qui concerne le contenu et la présentation des informations relatives au principe consistant à « ne pas causer de préjudice important »,
- dans les documents précontractuels, sur les sites internet et dans les rapports périodiques.

Règlement sur les indices de référence dans le cadre du SFDR : La réglementation impose à la Société de gestion d'expliquer aux investisseurs dans quelle mesure l'indice de référence du compartiment intègre des critères ESG ou des objectifs E/S (objectifs environnementaux ou sociaux). Les indices de référence généraux mentionnés dans le Prospectus ne tiennent pas compte de critères ou d'objectifs ESG.

ANNEXE 3 – RISQUES D'INVESTISSEMENT

Il est recommandé aux investisseurs potentiels de lire le prospectus attentivement avant de prendre toute décision d'investissement. Un investissement peut également être affecté par des changements liés aux règles régissant les contrôles de change, la fiscalité et les retenues à la source ainsi que ceux liés aux politiques économiques et monétaires.

Les investisseurs sont également avertis du fait que la performance des compartiments peut ne pas s'aligner sur les objectifs déclarés et que le capital investi (après déduction des commissions de souscription) peut ne pas être récupéré dans sa totalité.

Les compartiments sont exposés à différents risques qui varient selon la politique d'investissement qu'ils appliquent. Les principaux risques auxquels les compartiments sont susceptibles d'être exposés sont indiqués ci-dessous.

Certains compartiments peuvent être particulièrement sensibles à un ou plusieurs risques spécifiques, lesquels accentuent leur profil de risque par rapport aux compartiments uniquement sensibles aux risques génériques. Dans ces cas, ces risques sont spécifiquement mentionnés dans le Livre II.

Risque de crédit

Ce risque est présent dans tous les compartiments dont l'univers d'investissement est composé de titres de créance.

Il s'agit du risque pouvant résulter de la dégradation de la notation ou du défaut d'un émetteur d'obligations, pouvant de ce fait entraîner une baisse de valeur des investissements. Ce risque dépend de la capacité de l'émetteur à honorer le remboursement de sa dette.

Les dégradations de notation concernant une émission ou un émetteur peuvent induire une diminution de la valeur des obligations dans lesquelles le compartiment a investi.

Certaines stratégies utilisées peuvent être basées sur des obligations émises par des émetteurs présentant un risque de crédit moyen élevé (obligations à haut rendement).

Risque de liquidité

Ce risque concerne en principe l'ensemble des instruments financiers et peut donc, à un moment donné avoir un impact sur un ou plusieurs compartiments.

Il existe le risque que les investissements réalisés par les compartiments deviennent illiquides. En conséquence, il se peut qu'il ne soit pas possible de vendre ou d'acheter ces investissements dans le délai souhaité et à une juste valeur de marché, d'où un impact négatif sur les compartiments.

Les Actifs « distressed » (en difficulté) mentionnés dans le Livre II sont sujets à un risque de liquidité élevé.

Risque de contrepartie

Ce risque est lié à l'exposition des compartiments aux contreparties financières lorsqu'ils négocient des contrats de gré à gré. Il correspond au risque de pertes résultant du manquement d'une contrepartie à ses engagements (par exemple : paiement, livraison et remboursement).

Risque opérationnel et risque de conservation

Certains marchés sont moins réglementés que la plupart des marchés internationaux : par conséquent, les services liés à la conservation et à la liquidation des fonds peuvent être plus risqués sur de tels marchés.

Risque lié aux dérivés

Afin de couvrir les transactions du portefeuille (stratégie d'investissement portant sur la couverture des dérivés) ou de recourir à l'effet de levier pour obtenir des rendements (stratégie d'investissement portant sur la négociation des dérivés), les compartiments peuvent avoir recours à des techniques d'investissement et des instruments dérivés en vertu des circonstances stipulées aux Annexes 1 et 2 du Prospectus (notamment concernant les échanges de titres, taux d'intérêt, devises, taux d'inflation, volatilité et autres instruments financiers dérivés, CDS, futures et options sur titres, taux ou futures).

Nous attirons l'attention des investisseurs sur le fait que les stratégies de couverture peuvent se révéler inefficaces et ne pas remplir l'objectif souhaité, et que les stratégies de négociation peuvent inclure le recours à l'effet de levier et entraîner de ce fait une augmentation de la volatilité de ces compartiments. En conséquence, ces compartiments peuvent être négativement affectés par de telles stratégies d'investissement portant sur les dérivés.

Risque lié à un effet de levier élevé

Une faible baisse de la valeur d'un portefeuille d'actifs avec effet de levier entraînera une perte correspondante beaucoup plus élevée pour la Société. Un niveau d'effet de levier global élevé et/ou des conditions de marché inhabituelles peuvent engendrer des pertes importantes pour la Société.

Risque lié aux ventes à découvert synthétiques

La Société peut avoir une exposition équivalente à la valeur des titres vendus à découvert de manière synthétique. Ces ventes à découvert impliquent des coûts et des risques. Si le cours d'un titre vendu à découvert augmente, la Société peut être amenée à clôturer sa position courte à un prix supérieur à celui de la vente à découvert, se traduisant par des pertes. La Société peut ne pas être en mesure de clôturer une position courte à un prix acceptable et peut être contrainte de vendre des positions longues plus tôt que prévu. Sachant que les pertes de la société résultant d'une position courte proviennent de l'augmentation de valeur du titre, de telles pertes sont théoriquement illimitées. Dans certains cas, l'achat du montant notionnel d'un titre pour couvrir une position courte peut lui-même entraîner une hausse supplémentaire du cours du titre, et de ce fait accentuer lesdites pertes.

Risque lié aux marchés d'actions

Ce risque est présent dans tous les compartiments dont l'univers d'investissement est composé d'actions.

Les risques liés aux investissements en actions (et instruments similaires) incluent ceux relatifs aux fluctuations de cours, aux informations négatives concernant l'émetteur ou le marché et à la subordination des actions d'une société par rapport à ses obligations. Par ailleurs, ces fluctuations sont souvent amplifiées à court terme. Les compartiments investis dans les marchés d'actions peuvent voir leur valeur négativement affectée par de tels investissements.

Certains compartiments peuvent investir dans des introductions en bourse (IPO, initial public offering). Dans ce cas, il existe un risque que le cours de l'action nouvellement mise en circulation présente une volatilité supérieure en raison de facteurs tels que l'absence d'un marché public, des transactions non saisonnières, un nombre limité de titres disponibles à la négociation et un manque d'informations concernant l'émetteur. Un compartiment peut détenir de tels titres pendant une période très courte, ce qui tend à accroître les coûts.

Risque de taux d'intérêt

Ce risque est présent dans tous les compartiments dont l'univers d'investissement est composé de titres de créance.

La valeur d'un investissement peut être affectée par les fluctuations des taux d'intérêt. Les taux d'intérêt peuvent être influencés par plusieurs éléments ou événements tels que les politiques monétaires, les taux d'actualisation, l'inflation, etc.

Nous attirons l'attention de l'investisseur sur le fait qu'une augmentation des taux d'intérêt entraîne la baisse de la valeur des investissements en obligations et en instruments de créance.

Risque résultant d'un taux d'intérêt faible

Ce risque est présent dans tous les compartiments dont l'univers d'investissement est composé de titres de créance.

Un niveau de taux d'intérêt très faible peut avoir un impact sur le rendement des actifs à court terme détenus par des fonds monétaires pouvant être insuffisant pour couvrir les coûts de gestion et entraîner une diminution structurelle de la VNI du compartiment.

Risque de change

Ce risque est présent dans les compartiments ayant des positions libellées dans une devise différente de celle de leur devise de comptabilité.

Un compartiment peut détenir des positions libellées dans une devise différente de celle de sa devise de comptabilité et peut être affecté par les fluctuations de taux de change entre la devise de comptabilité et les autres devises ainsi que par les changements intervenant dans le contrôle des changes. Si la devise de libellé d'un titre s'apprécie par rapport à la devise de comptabilité du compartiment, la valeur de conversion du titre dans la devise de comptabilité augmente ; à l'inverse si la devise de libellé d'un titre se déprécie par rapport à la devise de comptabilité du compartiment, la valeur de conversion du titre diminue.

Lorsque le gestionnaire effectue une opération dans l'intention de couvrir le risque de change d'une transaction, rien ne garantit que ladite opération soit complètement efficace.

Risque d'inflation

Tous les types d'investissement sont concernés par ce risque.

Au cours du temps, les rendements des investissements à court terme peuvent ne pas suivre le rythme d'évolution de l'inflation, entraînant une réduction de pouvoir d'achat au regard de l'investissement.

Risque fiscal

Il s'agit d'un risque générique.

La valeur d'un investissement peut être affectée par l'application de lois fiscales dans différents pays, notamment celles relatives à la retenue d'impôt à la source, et des politiques gouvernementales, économiques ou monétaires des pays concernés. En conséquence, rien ne garantit que les objectifs financiers seront atteints.

Risque lié au marché des matières premières (dont le risque lié au marché de l'or)

Ce risque est présent dans tous les compartiments dont l'univers d'investissement est composé de matières premières (investies indirectement).

Les marchés des matières premières peuvent subir d'importantes variations de prix soudaines ayant un effet direct sur la valorisation des actions ou titres assimilables dans lesquels un compartiment investit et/ou sur les indices auxquels un compartiment est exposé.

Par ailleurs, les actifs sous-jacents peuvent évoluer d'une manière nettement différente de celle des marchés de titres traditionnels (marchés d'actions, d'obligations, etc.).

Risque lié aux marchés émergents

Les compartiments qui investissent dans les marchés émergents sont susceptibles de faire l'objet d'une volatilité supérieure à la moyenne en raison d'un degré important de concentration, d'un climat d'incertitude accru en raison d'une insuffisance d'informations, de moins de liquidité ou d'une sensibilité plus prononcée aux changements des conditions de marché (sociales, politiques et économiques). Par ailleurs, certains marchés émergents offrent moins de sécurité que la majorité des marchés développés internationaux. Pour cette raison, les prestataires offrant des services liés aux transactions, à la liquidation et à la conservation du portefeuille pour le compte des compartiments investis dans les marchés émergents peuvent être soumis à un risque plus élevé. En conséquence, les compartiments investis dans les marchés émergents peuvent voir leur valeur négativement affectée par de tels investissements. La Société et les investisseurs acceptent d'encourir ces risques.

Eu égard au marché russe, les investissements sont réalisés auprès de la Bourse de Moscou (Russian Trading System Stock Exchange ou « **RTS Stock Exchange** »), ce qui permet de rassembler un grand nombre d'émetteurs russes et une couverture quasiment totale de l'univers d'actions de ce pays. En investissant sur le RTS Stock Exchange, les investisseurs peuvent profiter de la liquidité du marché russe sans avoir à traiter leurs transactions en monnaie locale, étant donné que toutes les émissions peuvent être directement négociées en dollars américains.

Risques liés aux questions environnementales, sociales et de gouvernance

La comparaison entre différents portefeuilles sur la base des critères ESG peut être rendue difficile en raison de l'absence de normes suffisantes dans ce domaine

La sélection de titres selon les filtres environnementaux, sociaux et de gouvernance peut être très subjective. En effet, en raison de l'absence de normes suffisantes encadrant les critères et sous-critères ESG, les facteurs ESG intégrés aux processus d'investissement peuvent être différents en fonction des thèmes d'investissement, des catégories d'actifs, de la philosophie d'investissement et de

l'utilisation subjective des critères et sous-critères environnementaux, sociaux et de gouvernance déterminant la construction d'un portefeuille.

Les approches d'investissement ESG disponibles sur le marché peuvent être interprétées différemment

Il existe aujourd'hui un risque permanent « d'écoblanchiment » de portefeuilles, phénomène selon lequel certaines sociétés d'investissement exploitent la philosophie ESG à des fins uniquement commerciales au lieu de l'utiliser réellement à des fins d'investissement.

La performance des compartiments employant les critères ESG peut varier

L'utilisation des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance peut avoir une influence sur la performance des compartiments et, par conséquent, la performance des compartiments appliquant ces critères peut différer de celle de compartiments similaires ne les utilisant pas. En effet, les processus de sélection des investissements varient en raison des critères ESG.

L'évolution du mode de calcul des risques ESG complique leur évaluation

En raison de l'évolution continue de l'évaluation des risques ESG, il est généralement difficile de les mesurer directement comme des risques traditionnels. Par conséquent, la Société de gestion doit gérer les risques du fonds en fonction d'indicateurs indirects, tels que les scores (relatifs) obtenus par les entreprises sur la base d'un grand nombre de facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance mis à disposition sur le marché par les fournisseurs de données.

Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints

Les compartiments qui investissent dans les sociétés de petite capitalisation et appartenant à des secteurs spécialisés ou restreints sont susceptibles de faire l'objet d'une volatilité supérieure à la moyenne en raison d'un degré important de concentration, d'un climat d'incertitude accru, d'une insuffisance d'informations, de moins de liquidité ou d'une sensibilité plus prononcée aux changements des conditions de marché. Ces investissements peuvent avoir un effet négatif sur la valeur de ces compartiments.

Risque lié aux bons de souscription

Nous attirons l'attention de l'investisseur sur le fait que les bons de souscription sont des instruments complexes, volatils et à risque élevé : le risque de perte du capital investi est considérable. Par ailleurs, une des principales caractéristiques des bons de souscription est l'« effet de levier », qui se reflète dans le fait qu'un changement de valeur de l'actif sous-jacent peut avoir un effet disproportionné sur la valeur du bon de souscription. Finalement, rien ne garantit que, en cas de marché illiquide, il sera possible de vendre le bon de souscription sur un marché secondaire.

Risques liés aux investissements dans certains pays

Les investissements effectués dans certains pays (Chine, Inde, Indonésie, Japon, Arabie Saoudite et Thaïlande) impliquent des risques liés aux restrictions imposées aux contreparties et investisseurs étrangers, à une volatilité de marché plus élevée et à une insuffisance de liquidité pour certaines lignes d'investissement du portefeuille. En conséquence, certaines actions peuvent ne pas être disponibles pour le compartiment en raison du nombre limité d'actionnaires étrangers ou si le montant des investissements autorisé pour les actionnaires étrangers a été atteint. Par ailleurs, le rapatriement de la part du bénéfice net, capital et dividendes revenant à l'investisseur étranger peut être limité ou soumis à l'approbation du gouvernement. La Société investira dans ces pays uniquement si elle considère les restrictions comme acceptables. Toutefois, rien ne garantit que des restrictions supplémentaires ne seront pas imposées à l'avenir.

Risques spécifiques liés aux investissements en Chine

Risques liés au Shenzhen et au Shanghai-Hong Kong Stock Connect

Risque lié aux quotas

Stock Connect fait l'objet de quotas d'investissements, qui peuvent restreindre la capacité du compartiment à investir par l'intermédiaire de Stock Connect en temps voulu et le compartiment peut ne pas être en mesure d'appliquer efficacement ses politiques d'investissement.

Risque de suspension

La Bourse de Hong Kong (« SEHK ») et la Bourse de Shanghai (« SSE ») se réservent le droit de suspendre la négociation si nécessaire afin de garantir que le marché soit ordonné et équitable et de gérer prudemment les risques susceptibles de nuire au droit d'accès du compartiment au marché de la République populaire de Chine (« RPC »).

Différences de jour de négociation

Stock Connect fonctionne les jours où les marchés de RPC et de Hong Kong sont ouverts à la négociation et où les banques des deux marchés sont ouvertes les jours de règlement correspondants. Dans certains cas, il peut arriver que lors d'un jour de négociation normal pour le marché de la RPC, les investisseurs de Hong Kong ne puissent pas effectuer d'opérations de négociation. En conséquence, les compartiments peuvent être exposés à un risque de fluctuations des cours alors que Stock Connect ne fonctionne pas.

Restrictions à la vente imposées par le système de surveillance en amont

La réglementation de la RPC prévoit qu'avant qu'un investisseur puisse vendre une action, il doit disposer de suffisamment d'actions sur son compte ; dans le cas contraire, la SSE refusera l'ordre de vente concerné. La SEHK se charge de la vérification préalable à l'opération qui porte sur les ordres de vente de ses participants (à savoir les courtiers en bourse) pour garantir l'absence de survente.

Risques liés à la compensation, au règlement et à la conservation

La Hong Kong Securities Clearing Company Limited (la « HKSCC »), qui est une filiale de HKEx détenue à 100 %, et China Securities Depository and Clearing Corporation Limited (« ChinaClear ») établissent les connexions de compensation et sont toutes deux participantes vis-à-vis de l'autre pour permettre la compensation et le règlement des opérations transfrontalières. En tant que contrepartie centrale nationale du marché des titres de la RPC, ChinaClear gère un réseau complet d'infrastructures de compensation, de règlement et de détention de titres. ChinaClear a mis en place un cadre de gestion du risque, ainsi que des mesures afférentes qui sont approuvées et contrôlées par la CSRC. Le risque d'insolvabilité de ChinaClear est très faible. Si ChinaClear se retrouvait en situation d'insolvabilité et était, en conséquence, déclarée partie défaillante, HKSCC tenterait, de bonne foi, de recouvrer les encours et les fonds en souffrance auprès de ChinaClear par le biais des recours juridiques disponibles ou via la liquidation de ChinaClear. Dans

une telle éventualité, le compartiment peut accuser un certain retard en ce qui concerne le processus de recouvrement ou peut ne pas être en mesure de recouvrer l'intégralité de ses pertes auprès de ChinaClear.

Les actions négociées par l'intermédiaire du Shenzhen-Hong Kong Stock Connect ou du Shanghai-Hong Kong Stock Connect sont émises sous forme dématérialisée. Les investisseurs tels que les compartiments ne détiendront donc aucune action physique. Les investisseurs de Hong Kong et étrangers, tels que les compartiments, qui ont acquis des Titres SSE par le biais du Canal nord doivent conserver les Titres SSE sur les comptes actions de leurs courtiers ou dépositaires auprès du Système central de compensation et de règlement géré par HKSCC pour la compensation des titres cotés ou négociés sur la SEHK. De plus amples informations concernant les conditions de conservation relatives au système Stock Connect sont disponibles sur simple demande auprès du siège social de la Société de gestion.

Risque opérationnel

Stock Connect propose aux investisseurs de Hong Kong et étrangers, comme le compartiment, un nouveau canal d'accès direct à la bourse chinoise. Stock Connect repose sur le bon fonctionnement des systèmes opérationnels des participants du marché concerné. Les participants du marché peuvent utiliser ce programme à condition de satisfaire certaines exigences en matière de ressources informatiques, de gestion des risques et autres, prescrites, le cas échéant, par la bourse et/ou la chambre de compensation concernée(s).

Il faut tenir compte du fait que les régimes en matière de titres et les systèmes juridiques des deux marchés sont très différents et, pour que le programme à l'essai fonctionne, il est possible que les participants du marché doivent régler en continu des problèmes liés à ces différences.

Par ailleurs, la « connectivité » au programme Stock Connect implique un routage transfrontalier des ordres, qui suppose le développement de nouveaux systèmes informatiques de la part de la SEHK et des participants boursiers (à savoir un nouveau système de routage des ordres (« China Stock Connect System ») configuré par la SEHK et auquel les participants susmentionnés devront se connecter). Rien ne garantit que les systèmes de la SEHK et des participants du marché fonctionneront correctement ou continueront à être adaptés aux évolutions des deux marchés. Si lesdits systèmes ne fonctionnent pas correctement, cela peut perturber la négociation sur les deux marchés par l'intermédiaire du programme. Cela pourrait nuire à la capacité du compartiment à accéder au marché des actions A (et donc à la réalisation de sa stratégie d'investissement).

Accords de délégation au titre de la détention d'investissements

HKSCC est le « détenteur délégué » des titres SSE achetés par des investisseurs étrangers (y compris le compartiment) par l'intermédiaire de Stock Connect. Les règles Stock Connect de la China Securities Regulatory Commission (« CSRC ») prévoient explicitement que les investisseurs jouissent des droits et avantages liés aux titres SSE achetés par l'intermédiaire de Stock Connect conformément au droit applicable. Cependant, il reste possible que les tribunaux de RPC puissent statuer qu'un délégataire ou dépositaire agissant en qualité de détenteur inscrit de titres SSE peut jouir de l'intégralité de la propriété y relative et que, même si le concept de titulaire bénéficiaire est reconnu en vertu du droit de la RPC, lesdits titres SSE font partie du pool d'actifs d'une telle entité et peuvent donc être distribués à ses créanciers et/ou qu'un titulaire bénéficiaire ne peut faire valoir aucun droit sur les titres susvisés. Par conséquent, les compartiments et le Dépositaire ne peuvent pas assurer que la détention de ces titres, ou de droits y relatifs, par le compartiment, sera garantie en toute circonstance.

Au titre des règles du Système central de compensation et de règlement exploité par HKSCC pour la compensation des titres cotés ou négociés sur la SEHK, HKSCC, en sa qualité de détenteur délégué, n'est pas tenu d'intenter une action en justice ou un procès pour faire valoir des droits pour le compte des investisseurs eu égard aux titres SSE en RPC ou ailleurs. Par conséquent, bien que la propriété du compartiment concerné puisse être reconnue en fin de compte, le compartiment peut être confronté à des difficultés ou à des retards pour faire valoir ses droits.

Dans la mesure où HKSCC est réputée exercer des fonctions de conservation des actifs détenus par son intermédiaire, il convient de noter que le Dépositaire et les compartiments n'ont aucun lien juridique avec HKSCC et ne disposent d'aucun recours direct en justice à l'encontre de HKSCC au cas où les compartiments accuseraient des pertes liées à la performance ou à l'insolvabilité de HKSCC.

Risques liés à la propriété bénéficiaire et légale

Lorsque les titres sont conservés sur une base transfrontalière, il existe des risques particuliers liés à la propriété bénéficiaire/légale eu égard aux exigences des dépositaires centraux locaux de titres, de la HKSCC et de ChinaClear. Comme c'est le cas sur d'autres marchés émergents, l'unique cadre juridique commence à peine à développer le concept de propriété légale/officielle et de propriété bénéficiaire et d'intérêt ou de propriété bénéficiaires vis-à-vis de titres.

En cas d'insolvabilité de ChinaClear, HKSCC aura pour seule responsabilité, en vertu des contrats conclus sur le marché avec les participants à la compensation, d'apporter son soutien auxdits participants lors de réclamations. HKSCC tentera, de bonne foi, de recouvrer les encours et les fonds en souffrance auprès de ChinaClear par le biais des recours juridiques disponibles ou via la liquidation de ChinaClear. Dans une telle éventualité, les compartiments peuvent ne pas être en mesure de recouvrer l'intégralité de leurs pertes ou leurs titres en vertu des Programmes China Hong-Kong Stock Connect ou subir un retard au cours du processus de recouvrement.

Indemnisation des investisseurs

Les investissements des compartiments par le biais du Canal nord en vertu de Stock Connect ne seront pas couverts par le Fonds d'indemnisation des investisseurs de Hong Kong. Le Fonds d'indemnisation des investisseurs de Hong Kong est établi afin de verser des indemnités aux investisseurs de toute nationalité qui subissent des pertes pécuniaires résultant de l'insolvabilité d'un intermédiaire agréé ou d'une institution financière autorisée relativement à des produits négociés en bourse à Hong Kong.

Dans la mesure où, dans le cadre de Stock Connect, les défauts sur le Canal nord ne concernent pas des produits cotés ou négociés sur la SEHK ou Hong Kong Futures Exchange Limited, ces opérations ne seront pas couvertes par le Fonds d'indemnisation des investisseurs. Par ailleurs, étant donné que le compartiment effectue des opérations sur le Canal nord par le biais de courtiers en valeurs mobilières à Hong Kong et non de courtiers en RPC, il n'est pas protégé par le Fonds chinois de protection des investisseurs dans des titres en RPC.

Coûts liés à la négociation

Outre le versement de commissions et de droits de timbre au titre de la négociation, les compartiments peuvent être soumis à de nouveaux frais au niveau du portefeuille, à un impôt sur les dividendes et à l'impôt appliqué aux revenus issus des opérations sur titres, dont les autorités compétentes doivent encore fixer les montants.

Risque réglementaire

Les règles Stock Connect de la CSRC sont des réglementations ministérielles en vigueur en RPC. Cependant, l'application desdites règles n'a pas été testée, et rien ne garantit que les tribunaux de RPC les reconnaîtront, notamment dans le cadre de procédures de

liquidation de sociétés de RPC. Stock Connect est relativement nouveau par nature, et est soumis aux réglementations promulguées par les autorités de réglementation et aux règles exécutoires émanant des bourses de RPC et de Hong Kong. En outre, les autorités peuvent promulguer de nouvelles réglementations en tant que de besoin en lien avec les opérations et l'application légale lors d'opérations transfrontalières effectuées avec Stock Connect. Lesdites réglementations n'ont pas été testées pour l'instant et aucune certitude n'existe quant à leur application. En outre, la réglementation actuelle fait l'objet de modifications. Rien ne garantit que Stock Connect ne sera pas supprimé. Les compartiments, qui peuvent investir sur les marchés de RPC par l'intermédiaire de Stock Connect, peuvent subir l'incidence négative de ces modifications.

Contrôle gouvernemental de la conversion des devises et de l'évolution future des taux de change

Depuis 1994, la conversion du Renminbi onshore CNY dans d'autres devises se base sur les taux de la Banque populaire de Chine, fixés quotidiennement en référence au taux interbancaire du marché des changes de RPC du jour précédent. Le 21 juillet 2005, le gouvernement de RPC a introduit un système de gestion du taux de change flottant afin de permettre au CNY de fluctuer au sein d'une fourchette réglementée sur la base de l'offre et de la demande et en référence à un panier de devises. Il n'est donc pas garanti que le CNY ne fluctuera pas de manière importante vis-à-vis d'une autre devise dans l'avenir.

Risque de différence entre le Renminbi onshore et le Renminbi offshore

Bien que le Renminbi onshore (« CNY ») et le Renminbi offshore (« CNH ») constituent une seule et même devise, ils sont négociés sur des marchés différents et distincts. Le CNY et le CNH sont négociés à des taux différents et leurs fluctuations peuvent évoluer dans des sens opposés. Même si des volumes croissants de Renminbi sont détenus offshore (c'est-à-dire en dehors de la RPC), les montants versés en CNH en RPC sont contrôlés et font l'objet de restrictions et vice versa. L'attention des investisseurs est attirée sur le fait que les souscriptions et les rachats seront effectués en USD puis convertis en/depuis le CNH. En outre, les investisseurs devront supporter les frais de change découlant de cette conversion, ainsi que le risque de différence entre les taux de change du CNY et du CNH. Le taux de change et la liquidité du Renminbi en dehors de la RPC peuvent avoir un impact négatif sur la liquidité et le cours de négociation du compartiment.

Risque lié aux marchés soumis à des restrictions

Les compartiments peuvent investir dans des titres pour lesquels la RPC impose des limitations ou des restrictions sur la propriété ou la détention étrangères. Les restrictions ou limitations légales et réglementaires peuvent avoir une incidence négative sur la liquidité et sur la performance des positions des compartiments, par rapport à la performance de leur Indice de Référence. Cela peut accroître le risque d'écart de suivi et, au pire des cas, les compartiments risquent de ne pas atteindre leur objectif d'investissement et/ou les compartiments peuvent faire face à des risques de liquidité accrus.

Risque de suspension

Les actions ne peuvent être achetées ou vendues aux compartiments ponctuellement lorsque le titre concerné peut être acheté ou vendu sur la Bourse de Shanghai ou sur celle de Shenzhen, le cas échéant. Étant données la volatilité et l'instabilité de ces marchés (où il existe un risque de suspension d'un titre particulier ou d'intervention du gouvernement), la souscription et le rachat d'Actions peuvent également être perturbés.

Risque opérationnel et risque de règlement

Les procédures de règlement de la RPC sont moins développées et peuvent différer par rapport à celles de pays dotés de marchés financiers plus matures. Les compartiments peuvent être soumis à un risque de perte importante dans les cas où un agent désigné (tel qu'un courtier ou un agent de règlement) ne remplit pas ses obligations. Les compartiments peuvent subir des pertes importantes si leur contrepartie ne verse pas les sommes correspondantes aux titres qu'ils ont livrés ou, pour une raison quelconque, manque à ses obligations contractuelles envers eux. Par ailleurs, l'enregistrement du transfert des titres peut donner lieu à des retards de paiement sur certains marchés. Ces retards peuvent donc entraîner des pertes considérables pour le compartiment s'il est impossible de saisir certaines opportunités ou si les compartiments sont dans l'incapacité d'acquiescer ou de céder un titre. Par conséquent, il est fondamental de choisir le modèle de livraison contre paiement afin de limiter le risque de contrepartie.

Risque lié aux changements affectant le régime fiscal en RPC

Au cours des dernières années, le gouvernement de RPC a mis en place un certain nombre de réformes fiscales. Les lois et réglementations fiscales actuelles peuvent être soumises à des modifications futures. Toute modification des lois et réglementations fiscales peut avoir un impact sur le résultat net des sociétés de RPC, ainsi que sur les investisseurs étrangers détenant des actions de ces sociétés. Toute modification des politiques fiscales est susceptible d'entraîner une baisse du résultat net découlant des investissements auxquels la performance des compartiments est liée.

Risque lié aux interventions du gouvernement et aux restrictions imposées par les autorités

Le gouvernement et les autorités réglementaires sont susceptibles d'intervenir sur les marchés financiers, notamment en imposant des restrictions sur la négociation de certains titres. Ces interventions peuvent avoir une influence sur les opérations et les activités de tenue du marché des compartiments, ainsi qu'un impact imprévisible sur les compartiments.

Par ailleurs, elles sont également susceptibles d'avoir une incidence négative sur la confiance des investisseurs, pouvant, à son tour, affecter la performance des compartiments.

Risques liés aux investissements en obligations convertibles

La valeur des obligations convertibles est sujette à plusieurs facteurs dont les taux d'intérêt, le risque de crédit de l'émetteur, le cours et la devise de l'action sous-jacente, de la devise d'émission et du prix de l'option intégrée dans l'obligation convertible. Leur valeur peut varier sensiblement en fonction des conditions économiques et de taux d'intérêt, de la solvabilité de l'émetteur, de la performance de l'action sous-jacente et des conditions générales des marchés financiers. En outre, les émetteurs d'obligations convertibles peuvent manquer à leurs obligations de paiement et leurs notations de crédit peuvent être dégradées. Les obligations convertibles peuvent également être sujettes à moins de liquidité que celle dont disposent les titres de capital sous-jacents. En cas de changement défavorable, ces facteurs peuvent avoir un impact négatif sur les compartiments investis en obligations convertibles.

Risques liés aux investissements en obligations convertibles conditionnelles (CoCo)

Ces types d'obligations convertibles, également appelés obligations CoCo, CoCo ou obligations convertibles contingentes, sont référencés par le champ Bloomberg « Capital_contingent_Security ». Elles sont légèrement différentes des obligations convertibles normales, à savoir que la conversion des obligations en action est soumise à une « condition » qui n'est autre qu'un événement spécifique (le « seuil de déclenchement ») tel que le dépassement d'un certain niveau de prix de l'action d'une Société pour une période de temps définie. Si le seuil de déclenchement est atteint, l'obligation peut être sujette à conversion ou dépréciation et/ou à l'annulation

de son coupon. En conséquence, les compartiments investis dans des obligations convertibles conditionnelles peuvent subir des pertes. Par ailleurs, de tels investissements peuvent être erronément évalués en raison de leur complexité.

Ils bénéficient d'un avantage comptable étant donné que contrairement à d'autres obligations convertibles, ces titres ne doivent pas être inclus dans le bénéfice dilué par action jusqu'à ce que les obligations soient éligibles à la conversion. Elles représentent également une forme de capital dont les autorités de réglementation ont l'espoir qu'elles pourraient soutenir les finances d'une banque en situation de stress. Les CoCo sont différentes des obligations hybrides existantes, car elles sont conçues pour être converties en actions si le seuil de déclenchement prédéfini est franchi, de manière à renflouer soudainement le capital d'une société et plus généralement de rassurer les investisseurs. Les obligations hybrides, dont les CoCo, présentent des caractéristiques relevant tant des titres de créance que des actions. Elles sont destinées à agir comme un coussin entre les détenteurs d'obligations et d'actions seniors qui seront les premiers à souffrir en cas de perte du capital. Ces obligations permettent généralement à une banque de maintenir le capital jusqu'à ce que soit dépassée la date du premier remboursement ou d'éviter de payer les coupons d'intérêts.

Les investisseurs doivent comprendre entièrement, considérer et sous-peser correctement ces risques lors de la valorisation. Il existe un risque qui est inhérent aux seuils déclencheurs. Ces seuils permettent de définir l'exposition au risque de conversion, selon la distance à parcourir avant d'atteindre le seuil de déclenchement. La conversion pourrait ainsi être déclenchée par une perte importante sur le capital (numérateur) ou une augmentation des actifs pondérés du risque (dénominateur). En conséquence, l'obligation peut être convertie en action à un moment défavorable. Par ailleurs, il existe le risque d'annulation du coupon. Bien que toutes les CoCo soient sujettes à conversion ou à dépréciation lorsque la banque émettrice atteint le seuil de déclenchement, certaines d'entre elles présentent toutefois une source de risque supplémentaire pour l'investisseur, sous la forme d'une annulation du coupon sur la base du principe de continuité de l'exploitation. Les paiements de coupon sur ce type d'instruments sont entièrement discrétionnaires et peuvent être annulés par l'émetteur à tout moment, quelle qu'en soit la raison et pour aussi longtemps qu'il le souhaite. L'annulation des paiements de coupon liés aux CoCo n'équivaut pas à une situation de défaut. Les paiements annulés ne s'accumulent pas et sont au contraire dépréciés. Cela accroît sensiblement l'incertitude entourant la valorisation de tels instruments et peut entraîner la détermination erronée du niveau de risque. Les détenteurs de CoCo peuvent voir leurs coupons annulés tandis que l'émetteur continue de verser des dividendes sur ses actions ordinaires et une rémunération variable à ses employés. Contrairement à ce qui se passe dans une hiérarchie de capital classique, les investisseurs en CoCo peuvent également enregistrer une moins-value alors que les détenteurs d'actions sont épargnés. Dans certains cas, les détenteurs de CoCo essuieront des pertes avant les actionnaires, par exemple si le seuil de déclenchement d'une CoCo dotée d'un mécanisme de dépréciation est élevé. Ceci va à l'encontre de la hiérarchie de structure du capital ordinaire, dans le cadre de laquelle les actionnaires sont généralement les premiers touchés. Ce scénario est moins probable dans le cas des CoCo assorties d'un seuil de déclenchement moins élevé ; les actionnaires auront alors déjà enregistré des pertes. En outre, les investisseurs en CoCo assorties d'un seuil de déclenchement élevé peuvent essuyer des pertes, non pas à la liquidation, mais en théorie avant les détenteurs d'actions et de CoCo assorties d'un seuil de déclenchement moins élevé. Certaines CoCo sont émises en tant qu'instruments perpétuels pouvant être remboursés par anticipation à des niveaux prédéterminés, uniquement avec l'accord de l'autorité compétente. Rien ne garantit que les CoCo perpétuelles seront effectivement remboursées à la date de remboursement anticipé. De telles CoCo sont assimilées à des capitaux permanents. Dans ces cas, il se peut que l'investisseur ne récupère pas le principal, ni à la date de remboursement anticipé ni à toute autre date. Par ailleurs, d'autres risques liés à des « facteurs inconnus » peuvent apparaître. Il n'y a aucun moyen de savoir comment les CoCo se comporteront dans un environnement complexe, lorsque leurs caractéristiques sous-jacentes seront mises à l'essai. Si un émetteur atteint le seuil de déclenchement ou suspend le paiement de ses coupons, il est difficile de savoir si le marché jugera la situation comme un événement spécifique ou systémique. Dans ce dernier cas, il est possible que la dynamique de prix et la volatilité se propagent à toute la classe d'actifs. Le risque peut encore être renforcé selon le niveau d'arbitrage dont l'instrument sous-jacent fait l'objet. Sur un marché illiquide, la fixation des prix peut par ailleurs s'avérer très délicate. Finalement, le rendement souvent attrayant des CoCo, qui peut être perçu comme une prime de complexité, attire les investisseurs vers cet instrument. Le rendement est à l'origine de la forte demande enregistrée jusqu'à présent. Pourtant, on ne sait toujours pas si les investisseurs ont pleinement appréhendé les risques sous-jacents. Les CoCo offrent généralement un bon rendement par rapport aux titres de créance mieux notés du même émetteur ou à ceux d'autres émetteurs de notation équivalente. La question est de savoir si les investisseurs ont pris toute la mesure du risque de conversion ou d'annulation du coupon. Enfin, les investisseurs devraient dûment tenir compte du risque de concentration sectorielle et du risque de liquidité associés aux CoCo.

Risques liés aux investissements en obligations à haut rendement

Les compartiments qui investissent dans des obligations à haut rendement sont exposés à des risques substantiellement plus élevés par rapport ceux qui placent leurs actifs dans des instruments traditionnels. Lorsqu'un compartiment investit dans des obligations à haut rendement, il est possible qu'il soit soumis au risque de crédit associé aux instruments porteurs d'intérêts.

En comparaison aux titres de créance de qualité investment grade, les titres de créance de qualité inférieure à investment grade (appelés également obligations à haut risque), qu'ils soient notés ou non, sont spéculatifs, présentent un risque de défaillance plus important et peuvent être exposés à des fluctuations de prix plus importantes et à un risque de crédit accru. Cela est dû à la possibilité que l'émetteur ne soit pas en mesure de payer les intérêts et le capital, lorsqu'ils sont dus, en particulier en période de ralentissement économique ou de hausse des taux d'intérêt. La rétrogradation de la notation d'un émetteur unique ou d'émetteurs similaires connexes, dont les titres détenus par le Fonds sont importants, pourrait accroître considérablement et de manière inattendue l'exposition du Fonds aux titres de qualité inférieure à investment grade et aux risques qui leur sont associés, notamment le risque de liquidité et de défaillance. Le marché des titres de qualité inférieure à investment grade peut être moins liquide et, par conséquent, il peut être plus difficile d'évaluer ou de vendre ces titres à un prix acceptable, en particulier en période de volatilité ou de repli des marchés. Étant donné que le Fonds est en mesure d'investir dans des titres de qualité inférieure à investment grade, il est possible qu'il soit soumis à un risque de crédit supérieur à celui des fonds qui n'achètent que des titres de qualité investment grade. La rétrogradation de la notation d'un émetteur unique ou d'émetteurs similaires connexes, dont les titres détenus par le Fonds sont importants, pourrait accroître considérablement et de manière inattendue l'exposition du Fonds aux titres de qualité inférieure à investment grade et aux risques qui leur sont associés, notamment le risque de liquidité et de défaillance.

Risques liés aux investissements dans des Actifs « distressed » (en difficulté)

L'investissement dans des titres en difficulté peut engendrer des risques supplémentaires pour un compartiment. Ces titres sont essentiellement considérés comme spéculatifs en ce qui concerne la capacité de l'émetteur à payer des intérêts et le principal, ou à respecter d'autres conditions des documents relatifs à l'offre sur une longue période. Ils sont généralement non garantis et peuvent être subordonnés à d'autres titres en circulation et créanciers de l'émetteur. Ces émissions sont susceptibles d'avoir certaines caractéristiques en termes de qualité et de protection, mais ces caractéristiques sont contrebalancées par de fortes incertitudes ou une exposition importante au risque de conditions économiques défavorables. Par conséquent, un compartiment peut perdre l'ensemble de son investissement, peut être tenu d'accepter des liquidités ou des titres de valeur inférieure à son investissement initial et/ou peut être tenu d'accepter un paiement sur une longue période. Le recouvrement des intérêts et du principal peut entraîner des frais

supplémentaires pour le compartiment concerné. Dans de telles circonstances, les revenus générés par les investissements du compartiment concerné risquent de ne pas dédommager suffisamment les actionnaires pour les risques encourus.

Risque de marché lié aux risques de durabilité

Le cours de marché peut également être affecté par les risques liés aux aspects ESG. Par exemple, les prix du marché peuvent évoluer si les entreprises n'agissent pas de manière durable et n'investissent pas dans des transformations durables. De même, les orientations stratégiques des sociétés qui ne tiennent pas compte de la durabilité peuvent avoir un impact négatif sur le cours des actions. Le risque de réputation découlant d'opérations sur titres contraires à la durabilité peut également avoir un impact négatif. En outre, les dommages physiques causés par le changement climatique ou les mesures de transition vers une économie à faible émission de carbone peuvent également avoir un impact négatif sur le prix de marché.

Risque de durabilité

Le risque de durabilité environnementale, sociale et gouvernance (ESG) désigne un événement ou une situation dans le domaine environnemental, social ou de la gouvernance qui, s'il survient, pourrait avoir une incidence négative importante sur la valeur de l'investissement. Le risque de durabilité peut représenter un risque en soi ou avoir un impact sur d'autres risques et contribuer de manière significative aux risques, comme les risques de marché, les risques opérationnels, les risques de liquidité ou les risques de contrepartie.

Les risques de durabilité peuvent entraîner une détérioration significative du profil financier, de la liquidité, de la rentabilité ou de la réputation de l'investissement sous-jacent. À moins que le risque de durabilité n'ait déjà été anticipé et pris en compte dans la valorisation des investissements, il peut avoir un impact négatif significatif sur le cours de marché prévu/estimé et/ou sur la liquidité de l'investissement et donc sur le rendement des compartiments.

ANNEXE 4 – COGESTION

Afin de réduire les frais d'exploitation et administratifs tout en permettant une plus grande diversification des investissements, le Conseil d'administration peut décider de co-gérer tout ou partie des actifs des compartiments de la Société ensemble (mécanisme intra-pooling). Dans les paragraphes ci-après, le terme « actifs cogérés » fait référence à tous les actifs appartenant à ces compartiments cogérés qui sont cogérés en vertu de cet accord de cogestion.

Dans ce cas, les actifs des différents compartiments seront gérés en commun. Les actifs cogérés seront appelés un « pool », en dépit du fait que lesdits « pools » soient exclusivement utilisés à des fins de gestion interne. Les « pools » ne constituent pas des entités juridiques séparées et ne sont pas directement accessibles aux investisseurs. Chacun des compartiments cogérés a droit à ses actifs spécifiques et est responsable de ses passifs.

Dans le cadre d'une cogestion, le gestionnaire prend des décisions d'achat, de vente ou d'ajustement du portefeuille pour les entités cogérées dans leur ensemble, qui affecteront la composition des portefeuilles de ses compartiments cogérés. Sur la totalité des actifs cogérés, chacun des compartiments cogérés détient une part du total des actifs cogérés correspondant à la part de ses actifs nets en rapport à la valeur totale des actifs cogérés. Cette participation proportionnelle sera appliquée à chaque ligne d'investissement du portefeuille détenue ou acquise sous contrat de cogestion. En cas de décisions d'investissement ou de vente, ces parts ne seront pas affectées et les investissements supplémentaires seront alloués aux compartiments cogérés dans les mêmes proportions et les actifs vendus seront déduits proportionnellement des actifs cogérés détenus par chaque compartiment cogéré.

En cas de nouvelles souscriptions effectuées auprès d'un des compartiments cogérés, les produits des souscriptions seront alloués aux compartiments cogérés dans les proportions modifiées en résultat de l'augmentation des actifs nets du compartiment cogéré qui a reçu les souscriptions, et toutes les lignes d'investissement du portefeuille seront ajustées par transferts des actifs d'un compartiment cogéré à l'autre afin de s'adapter aux proportions modifiées. De manière similaire, en cas de rachats effectués dans un des compartiments cogérés, le montant en numéraire nécessaire sera déduit du numéraire détenu par les compartiments cogérés dans les proportions modifiées en résultat de la diminution des actifs nets du compartiment cogéré dans lequel les achats ont été effectués, et dans ce cas, toutes les lignes d'investissement du portefeuille seront ajustées dans les proportions modifiées. Les investisseurs doivent être conscients que, sans intervention spécifique des autorités compétentes de la Société, la technique de cogestion peut faire en sorte que la composition des actifs des compartiments cogérés soit influencée par des événements spécifiques touchant les autres compartiments cogérés tels que les souscriptions et les rachats. Par conséquent, toutes choses étant égales par ailleurs, les souscriptions effectuées dans l'un des compartiments cogérés se feront de sorte à augmenter les actifs du ou des autres compartiments cogérés. À l'inverse, les rachats effectués auprès d'un des compartiments cogérés se traduiront par une augmentation ou une diminution des liquidités du ou des autres compartiments cogérés. Les souscriptions et rachats peuvent, cependant, être retenus dans le compte spécifique détenu par chaque compartiment cogéré parallèlement à l'accord de cogestion à travers lequel les souscriptions et les rachats sont normalement effectués. L'attribution des souscriptions et des rachats majeurs à un compte spécifique ainsi que l'option pour le Conseil d'administration de décider à tout moment d'interrompre la gestion en commun permettront aux ajustements du portefeuille des compartiments de la Société d'être compensés si ces ajustements sont réputés aller à l'encontre des intérêts des compartiments et des investisseurs de la Société. Dans le cas où un ajustement de la composition du portefeuille d'un ou plusieurs des compartiments cogérés de la Société, s'avérant nécessaire du fait des rachats ou paiements de dépenses attribuables à un autre compartiment cogéré, risquerait d'entraîner une non-observation des restrictions d'investissement correspondantes, les actifs concernés seraient exclus de l'accord de cogestion avant que l'ajustement soit mis en œuvre de manière à ce que les mouvements de portefeuille ne soient pas affectés.

Les actifs cogérés seront uniquement cogérés avec des actifs destinés à être investis conformément à un objectif d'investissement identique applicable aux actifs cogérés de manière à garantir que les décisions d'investissement soient entièrement compatibles avec la politique d'investissement des compartiments de la Société. Les actifs cogérés seront uniquement cogérés avec des actifs pour lesquels le Dépositaire agit également en tant que conservateur de manière à ce que ce dernier puisse, au regard des compartiments de la Société, exercer pleinement ses fonctions et responsabilités conformément aux dispositions prévues par la Loi.

Le Dépositaire garantira à tout moment une séparation rigoureuse des actifs des compartiments cogérés et sera en mesure, à ce titre et à tout moment, de déterminer les actifs appartenant aux compartiments cogérés.

Un accord de gestion en commun a été ou sera signé entre la Société, le Dépositaire/l'Agent de registre et la Société de gestion afin de définir les droits et obligations de chaque partie. Le Conseil d'administration peut à tout moment et sans préavis décider d'interrompre l'accord de cogestion.

Les investisseurs peuvent, à tout moment, contacter le siège social de la Société pour obtenir des informations sur le pourcentage d'actifs cogérés.

Liquidation, fusion, transfert et scission des compartiments

Le Conseil d'administration aura le pouvoir exclusif de décider de l'effectivité des termes de ce qui suit, en vertu des limitations et des conditions prescrites par la Loi :

- 1) soit, la liquidation pure et simple d'un compartiment ;
- 2) ou la clôture d'un compartiment (le compartiment absorbé) par transfert dans un autre compartiment de la Société ;
- 3) ou la clôture d'un compartiment (le compartiment absorbé) par transfert dans un autre OPC, s'il est constitué en vertu de la Loi du Luxembourg ou établi dans un autre État membre de l'Union européenne ;
- 4) ou le transfert dans un compartiment (le compartiment absorbant), a) d'un autre compartiment de la Société, et/ou b) d'un compartiment d'un autre organisme de placement collectif, s'il est constitué en vertu de la Loi du Luxembourg ou établi dans un autre État membre de l'Union européenne, et/ou c) d'un autre organisme de placement collectif, s'il est constitué en vertu de la Loi du Luxembourg ou établi dans un autre État membre de l'Union européenne ;
- 5) ou la division d'un compartiment.

Les techniques de division seront les mêmes que les techniques de fusion prévues par la Loi.

Nonobstant ce qui précède, si la Société cesse d'exister, à la suite d'une fusion de ce type, l'effectivité de cette fusion doit être décidée lors d'une Assemblée générale de la Société pour déterminer de manière valide la part du capital représenté. Les résolutions sont prises à la majorité simple des votes exprimés. Les votes exprimés n'incluent pas ceux rattachés aux actions dont les détenteurs n'ont pas voté, se sont abstenus, ont voté blanc ou « non ».

Il pourra, dans les deux mois précédant les opérations susmentionnées, être dérogé à la politique d'investissement du compartiment concerné telle que décrite dans le Livre II.

En cas de liquidation pure et simple d'un compartiment, les actifs nets seront distribués entre les parties éligibles proportionnellement aux actifs qu'elles détiennent dans ledit compartiment. Les actifs non distribués dans les neuf mois à compter de la date de décision de la liquidation seront déposés auprès de la Caisse de Consignation jusqu'à la fin de la période légale spécifiée.

En vertu de cette opération de fusion, la décision adoptée au niveau du compartiment peut être adoptée de manière similaire au niveau d'une catégorie ou d'une sous-catégorie.

Liquidation d'un compartiment Nourricier

Un compartiment Nourricier sera liquidé :

- lorsque le compartiment Maître est liquidé, sauf si la CSSF autorise le compartiment Nourricier à :
 - investir au moins 85 % de ses actifs en parts ou actions d'un autre compartiment maître ; ou
 - modifier sa politique d'investissement afin de se transformer en un compartiment non Nourricier.
- lorsque le compartiment Maître fusionne avec un autre OPCVM ou compartiment, ou est divisé en deux ou plusieurs OPCVM ou compartiments sauf si la CSSF autorise le compartiment Nourricier à :
 - conserver son statut de compartiment Nourricier du même compartiment Maître ou d'un autre OPCVM issu de la fusion ou de la division du compartiment Maître ;
 - investir au moins 85 % de ses actifs en parts ou actions d'un autre compartiment Maître ; ou
 - modifier sa politique d'investissement afin de se transformer en un compartiment non Nourricier.

Dissolution et liquidation de la Société

Le Conseil d'administration peut à tout moment et pour quelque raison que ce soit, proposer lors de l'Assemblée générale la dissolution et la liquidation de la Société. L'Assemblée générale rendra sa décision en suivant les mêmes procédures que celles appliquées pour la modification des Statuts.

Si le capital de la Société tombe en deçà des deux tiers du capital minimum légal, le Conseil d'administration pourra soumettre la question de la dissolution de la Société à l'Assemblée générale. L'Assemblée générale prendra sa décision, sans quorum requis, à la simple majorité des votes des actionnaires présents ou représentés, les abstentions n'étant pas prises en compte.

Si le capital de la Société est réduit en deçà d'un quart du capital minimum légal, le Conseil d'administration sera tenu de soumettre la question de la dissolution de la Société à l'Assemblée générale. L'Assemblée générale prendra sa décision, sans quorum requis, sur la base d'un quart des votes des actionnaires présents ou représentés, les abstentions n'étant pas prises en compte.

En cas de dissolution de la Société, la liquidation sera conduite par un ou plusieurs liquidateurs pouvant être des personnes physiques ou des entités juridiques. L'Assemblée générale pourvoira à la désignation des liquidateurs ainsi qu'à la détermination de leurs pouvoirs et rémunération, sans préjudice de l'application de la Loi.

Les produits nets de la liquidation de chaque compartiment, catégorie ou sous-catégorie seront distribués aux actionnaires par les liquidateurs de chaque compartiment, catégorie ou sous-catégorie proportionnellement au nombre d'actions qu'ils détiennent dans chaque compartiment, catégorie ou sous-catégorie.

En cas de liquidation directe de la Société, les actifs nets seront distribués aux parties éligibles proportionnellement aux actions détenues dans la Société. Les actifs nets non distribués dans une période maximale de neuf mois à compter de la date de la liquidation seront déposés auprès de la Caisse de Consignation jusqu'à la fin de la période légale spécifiée.

Le calcul de la VNI ainsi que toutes les souscriptions, conversions et rachats d'actions dans ces compartiments seront également suspendus tout au long de la période de liquidation.

L'Assemblée générale doit avoir lieu dans les quarante jours à compter de la date à laquelle il est établi que les actifs nets de la Société sont tombés en deçà du seuil minimum légal de deux tiers ou un quart, selon le cas.

LIVRE II DU PROSPECTUS
—
GESTIONNAIRE UNIQUE

ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities

sous son nom abrégé ABN AMRO Aegon Global Impact Equities

ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions mondiales dont les sociétés génèrent des avantages socioéconomiques ou environnementaux mesurables, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Le compartiment suit une stratégie d'investissement durable multithématique. Le compartiment sera composé d'émetteurs exposés aux Objectifs de développement durable (ODD) des Nations unies et en tenant compte de la méthodologie Évaluation des solutions ODD (SDGA) d'ISS. Dans le cadre de son objectif d'investissement durable, le compartiment investit dans des émetteurs contribuant positivement aux solutions environnementales et sociales.

Politique d'investissement

Le compartiment est activement géré en combinant la modélisation financière quantitative et qualitative avec la recherche d'impact. Des investissements seront effectués dans des sociétés dont la croissance est tirée par les thèmes d'impact durable à long terme et qui visent à avoir un impact positif mesurable sur les plans social, économique et environnemental et offrant un bon rendement financier.

L'impact peut être mesuré selon différents facteurs, comme la réduction des émissions de CO₂, la production d'énergies renouvelables (en MW), le nombre d'emplois créés et le nombre de personnes ayant accès à l'éducation. Selon le Gestionnaire d'investissement, ces sociétés seront dotées d'un fort potentiel de croissance en raison de leur alignement sur ces thèmes, de leur excellente gestion et de leurs solides fondamentaux commerciaux. Il en résulte, en outre, un portefeuille composé de 40 à 80 titres de qualité évalués de manière raisonnable (cette fourchette pouvant toutefois varier en fonction des conditions de marché).

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières de, sociétés situées dans le monde entier.

L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des marchés émergents, y compris des actions chinoises (Actions A).

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds conformes à l'article 9 du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers et qui ont été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment peut également investir dans des titres de créance (tels que des obligations à taux fixe et variable, des Instruments du marché monétaire, y compris des obligations à haut rendement) à concurrence de 10 % de ses actifs nets, notamment à des fins de gestion de trésorerie.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment et des Instruments du marché monétaire.

Politique d'investissement durable

Le compartiment contribue ainsi aux objectifs environnementaux et sociaux et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 9 du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers.

Chaque titre du portefeuille doit être couvert par la recherche en matière de durabilité. La trésorerie n'est pas couverte par l'analyse ESG.

Il est prévu que les caractéristiques ESG du compartiment qui en résultent soient supérieures au Portefeuille de référence et que l'univers d'investissement initial soit réduit d'au moins 20 % après l'application des critères de durabilité. Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 9.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities **sous son nom abrégé ABN AMRO Aegon Global Impact Equities**

Instruments dérivés

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement

ABN AMRO Investment Solutions

Conseiller externe

ABN AMRO Bank N.V.

Distributeur dédié

Le compartiment a été lancé à l'initiative d'Aegon Investment Management B.V., une société à responsabilité limitée de droit néerlandais dont le siège social est sis aux Pays-Bas, Aegonplein 50, 2591 TV La Haye. Le compartiment est distribué exclusivement par la Société de gestion et par Aegon Investment Management B.V. par le biais de son réseau de distribution dédié. Aegon Investment Management B.V. n'est pas impliqué dans la gestion d'investissement et ne fournit pas de services de conseil, mais fournit au Gestionnaire d'investissement des rapports sur l'engagement en matière d'ESG. Le rapport sur l'engagement sera composé des principales actions entreprises par Aegon Investment Management B.V. auprès des sociétés émettrices en vue d'améliorer les pratiques ESG. Les commissions de distribution font partie des commissions de gestion et aucune commission supplémentaire ne sera prélevée au niveau du compartiment.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque opérationnel et risque de conservation
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Aegon Global Impact Equities

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|--------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU2386528470 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| | DIS | LU2386528553 | | | | |
| Catégorie A3 | CAP | LU2386528637 | Oui | Non | Investisseurs clients d'Aegon ou de ses sociétés affiliées et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| | DIS | LU2386528801 | | | | |
| Catégorie A4 | CAP | LU2386528983 | Oui | Non | Investisseurs clients d'Aegon et utilisant la catégorie d'actions pour des activités de conseil et de gestion de portefeuille discrétionnaire et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| | DIS | LU2386529015 | | | | |
| Catégorie R | CAP | LU2386529106 | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU2386529288 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie D | CAP | LU2386529361 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU2386529445 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neulize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie G | CAP | LU2445654333 | Oui | Non | Investisseurs clients de la Gestion de portefeuille discrétionnaire des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et ayant conclu un accord de commissions spécifique et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU2445654416 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |
| Catégorie X | CAP | LU2386529528 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels et OPC | 20 000 000 EUR |
| | DIS | LU2386529791 | | | | |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|--------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,30% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie A3 | 0,75% | - | - | 0,18 % | 0,05% |
| Catégorie A4 | 0,55% | - | - | 0,18 % | 0,05% |
| Catégorie R | 0,75% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,75% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,75% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,75% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie G | 1,30% | - | - | 0,18 % | 0,01 % |
| Catégorie I | 0,65% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie X | 0,40% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Aegon Global Impact Equities

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|--------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie A3 | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie A4 | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie R | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie G | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |
| Catégorie X | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 5 juillet 2022.

Néant.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux investisseurs potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement

ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

sous son nom abrégé ABN AMRO Amundi European ESG Equities

ABN AMRO Funds Amundi EuropeanEquities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions européennes, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières de, sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique en Europe. L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. Le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Les investissements en titres de créance n'excéderont pas 15 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales ou sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

Le processus de sélection ESG (exclusions et filtres ESG) entraînera la suppression des investissements d'au moins 20 % de l'univers initial, car ces investissements ne seront pas éligibles (exclusions, niveau des notations ESG).

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut investir dans des instruments financiers dérivés à des fins d'exposition et de couverture.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures d'indices d'action et les futures de change) à des fins d'investissement, de couverture et de gestion efficace de portefeuille ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Amundi Ireland Limited

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque opérationnel et risque de conservation

ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Amundi European ESG Equities

- Risque lié aux marchés émergents
Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risque lié aux bons de souscription

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1577879262 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU1577879346 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie D | CAP | LU1577879429 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1577879692 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neuflyze OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,50% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En EUR pour les catégories suivantes : « Catégorie A », « Catégorie C », « Catégorie D » et « Catégorie F ».

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Amundi European ESG Equities

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Ce compartiment a été lancé le 21 novembre 2017 sous la dénomination « Asian Equities ».

Le 1^{er} février 2018, le compartiment a remplacé son ancien nom « Pioneer European Equities » par « Amundi European Equities ».

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Aristotle US Equities **sous son nom abrégé ABN AMRO Aristotle US Equities**

ABN AMRO Funds Aristotle US Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions américaines, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré activement selon une approche ascendante/fondamentale de sélection de titres, conçue pour détecter les sociétés assorties d'activités de qualité supérieure, attractives en termes de valorisation et présentant des catalyseurs spécifiques. Il en résulte un portefeuille ciblé à forte conviction (comprenant généralement entre 30 et 40 avoirs, cette fourchette pouvant toutefois varier en fonction des conditions du marché), principalement investi dans des sociétés de grande capitalisation.

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières tels que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières, de sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique en Amérique du Nord. L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Les investissements en titres de créance n'excéderont pas 15 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

En vertu des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance de ManCo et conformément aux Principes pour l'investissement responsable des Nations Unies, le compartiment exclut tout investissement direct dans des titres émis par des sociétés impliquées dans des activités hautement controversées (telles que la production de tabac et d'armes controversées) et/ou en violation grave des principes du Pacte mondial des Nations Unies.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Aristotle Capital Management, LLC

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque lié aux bons de souscription

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

ABN AMRO Funds Aristotle US Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Aristotle US Equities

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|------------------|------------------|--|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU0851647163 « Catégorie A-EUR » LU0849851125 « Catégorie A-USD » | Oui | Non | Tous | 100 EUR 100 USD |
| | DIS | LU1670605523 « Catégorie A-GBP » | | Oui | | 100 GBP |
| Catégorie AH EUR | CAP | LU1165272862 | | Non | | 100 EUR |
| Catégorie R | CAP | LU1670605796 « Catégorie R-EUR » LU1670605952 « Catégorie R-USD » | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR 100 USD |
| | DIS | LU1670605879 « Catégorie R-GBP » | | Oui | | 100 GBP |
| Catégorie RH EUR | CAP | LU1718324202 | | Non | | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU0849851398 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie D | CAP | LU1406018967 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1329507500 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neufelize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU1308664413 « Catégorie I-EUR » LU0849851471 « Catégorie I-USD » | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires et OPC | 1 000 000 EUR 1 000 000 USD |
| | Catégorie IH EUR | CAP | | | | LU0949827587 |
| Catégorie X1 | CAP | LU2341654619 « Catégorie X1-EUR » LU2304587079 « Catégorie X1-USD » | Oui | Non | Investisseurs autorisés | 50 000 000 EUR 50 000 000 USD |
| Catégorie X1H | CAP | LU2341654700 | Oui | Non | Investisseurs autorisés | 50 000 000 EUR |
| Catégorie Z | CAP | LU1670606091 | Oui | Non | Investisseurs autorisés | 100 000 000 USD |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

ABN AMRO Funds Aristotle US Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Aristotle US Equities

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|----------------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégories A, AH EUR | 1,50% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégories R, RH EUR | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégories I, IH EUR | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |
| Catégorie X1, X1H | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |
| Catégorie Z | 0,00% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|----------------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégories A, AH EUR | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégories R, RH EUR | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégories I, IH EUR | - | - | - |
| Catégorie X1, X1H | - | - | - |
| Catégorie Z | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'USD est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En USD pour les catégories suivantes : « Catégorie A-USD », « Catégorie R-USD », « Catégorie I-USD », « Catégorie X1-USD » et « Catégorie Z ».

En EUR pour les catégories suivantes : « Catégorie A-EUR », « Catégorie AH EUR », « Catégorie R-EUR », « Catégorie RH EUR », « Catégorie C », « Catégorie D », « Catégorie F », « Catégorie I-EUR », « Catégorie IH EUR » et « Catégorie X1-EUR ».

En GBP pour les catégories suivantes : « Catégorie A-GBP » et « Catégorie R-GBP ».

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 13 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

ABN AMRO Funds Aristotle US Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Aristotle US Equities

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 4 avril 2013. La catégorie de capitalisation « Catégorie X1-USD » a été lancée le 11 mars 2021 et la catégorie de capitalisation « Catégorie X1-EUR » a été lancée le 27 mai 2021.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds sous son nom abrégé Baring Emerging Markets ESG Bonds

ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'obligations des marchés émergents durables, sans aucune restriction spécifique sur l'écart de suivi. Le compartiment utilise une sélection de titres respectant les critères de responsabilité environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG). Le portefeuille est composé d'émetteurs qui sont soit des leaders dans les pratiques ESG, soit attractifs en raison de leur progression sur les questions ESG.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré selon une approche descendante et ascendante axée sur la recherche en matière d'ESG. L'approche descendante est axée sur le risque pays et les tendances globales du marché, tandis que le processus ascendant repose sur une analyse fondamentale. La recherche ESG du Gestionnaire d'investissement externe permet de sélectionner les enjeux présentant le moins de risque ESG ainsi que ceux qui améliorent le plus leur profil de risque ESG.

Le compartiment investit principalement dans des titres de créance d'émetteurs (qui ne sont soumis à aucune contrainte en matière de notation) situés, ayant leur siège social, ou exerçant une part prépondérante de leur activité économique dans des pays émergents.

Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le compartiment peut également avoir recours à une variété (i) d'instruments dont, entre autres, des contrats à terme de taux, des contrats de change à terme (incluant les contrats de change à terme non livrables), des futures de taux d'intérêt, des futures d'obligations et des swaps négociés de gré à gré tels que des swaps de taux d'intérêt et des swaps de défaut de crédit, et (ii) de stratégies axées, notamment, sur l'anticipation des fluctuations de taux, le positionnement sur la courbe de rendements, la sélection des émetteurs, la valeur relative et les devises.

L'univers d'investissement du compartiment comprend les titres de créance en devises forte et locale.

L'allocation d'actifs minimum sur une base consolidée (investissements directs et indirects via l'utilisation d'instruments dérivés) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment sera tenu, pour les 40 % du total de ses actifs nets restants et sur une base consolidée, de respecter toutes les limitations établies au regard des investissements en titres/instruments mentionnés ci-dessous :

(i) 10 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des titres de capital négociables ;

(ii) 10 % maximum des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

L'allocation aux actions sera le résultat de la conversion des obligations convertibles en actions. Le gestionnaire n'est pas autorisé à acheter activement des titres de capital.

Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs, mais peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des Actifs « distressed » (en difficulté).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment, et dans des Instruments du marché monétaire, y compris des certificats de dépôt et des dépôts à court terme.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales ou sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

Le processus de sélection ESG (exclusions et filtres ESG) entraînera la suppression des investissements d'au moins 20 % de l'univers initial, car ces investissements ne seront pas éligibles (exclusions, niveau des notations ESG).

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds sous son nom abrégé Baring Emerging Markets ESG Bonds

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) à des fins d'investissement, de couverture et de gestion efficace de portefeuille ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

La méthode de calcul du Portefeuille de référence est disponible sur le site Internet suivant : www.jpmorgan.com

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Baring Asset Management Limited

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque de taux d'intérêt
- Risque de change
- Risques liés aux obligations à haut rendement
- Risque de liquidité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds
sous son nom abrégé Baring Emerging Markets ESG Bonds

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|------------------|----------------|-------------------------------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU2281289533 « Catégorie A-EUR » | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie AH USD | | LU2281289616 | | | | 100 USD |
| Catégorie R | CAP | LU2281289889 « Catégorie R-EUR » | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie RH USD | | LU2281289962 | | | | 100 USD |
| Catégorie CH USD | CAP | LU2281290200 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 USD |
| | DIS | LU2281290382 | | Oui | | |
| Catégorie C | CAP | LU2281290465 | Oui | Non | | 5 000 EUR |
| | DIS | LU2281290549 | | Oui | | |
| Catégorie DH USD | CAP | LU2281290622 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 USD |
| Catégorie D | DIS | LU2281290895 | Oui | Non | | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU2281290978 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neufelize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU2281291190 « Catégorie I-EUR » | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires et OPC | 1 000 000 EUR |
| Catégorie IH USD | | LU2281291273 | | | | 1 000 000 USD |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|----------------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégories A, AH USD | 1,30% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégories R, RH USD | 0,75% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégories C, CH USD | 0,75% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégories D, DH USD | 0,75% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégorie F | 0,75% | - | - | 0,25 % | 0,01% |
| Catégories I, IH USD | 0,65% | - | - | 0,25 % | 0,01% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds
sous son nom abrégé Baring Emerging Markets ESG Bonds

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription ⁽²⁾ | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat ⁽²⁾ |
|----------------------|---|---|-------------------------------------|
| Catégories A, AH USD | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégories R, RH USD | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégories C, CH USD | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégories D, DH USD | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégories I, IH USD | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En USD pour les catégories suivantes : « Catégorie AH-USD », « Catégorie RH-USD », « Catégorie CH-USD », « Catégorie DH-USD » et « Catégorie I-USD ».

En EUR pour les catégories suivantes : « Catégorie A-EUR », « Catégorie R-EUR », « Catégorie C-EUR », « Catégorie D-EUR », « Catégorie F-EUR » et « Catégorie I-EUR ».

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 9 décembre 2021.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds **sous son nom abrégé ABN AMRO Blackrock Euro Government ESG Bonds**

ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation de la croissance du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'obligations d'État libellées en euro, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi. Le compartiment utilise une sélection de titres respectant les critères de responsabilité environnementaux, sociaux et de gouvernance (« ESG »). Le portefeuille est composé d'émetteurs qui sont soit des leaders dans les bonnes pratiques ESG, soit attractifs en raison de leur progression sur les questions ESG.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des obligations et des titres considérés comme des produits équivalents aux obligations tels que des obligations à revenu fixe et à taux variable, libellés en euro et émis ou garantis par un État membre de l'Union européenne appartenant à la zone euro ainsi que dans des dérivés de ce type d'actifs. Les investissements dans ces actifs ne seront soumis à aucune contrainte en matière de notation. Le compartiment allouera un minimum de 60 % de ses actifs nets à de tels titres.

Outre les limitations susmentionnées, le compartiment sera tenu, pour les 40 % du total de ses actifs nets restants et sur une base consolidée de respecter toutes les limitations indiquées à continuation au regard des investissements en titres/instruments mentionnés ci-après pouvant être regroupés jusqu'à hauteur d'un tiers du total de ses actifs nets.

- (i) 25 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des obligations libellées en euros et émises par des gouvernements situés en dehors de la zone euro ;
- (ii) un tiers maximum du total des actifs nets du compartiment peut être investi dans des instruments du marché monétaire ;
- (iii) 10 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans d'autres OPCVM ou OPC.

Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs et/ou des Actifs « distressed » (en difficulté).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 90 % du portefeuille.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Blackrock Investment Management (UK) Ltd

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds sous son nom abrégé ABN AMRO Blackrock Euro Government ESG Bonds

- Risque lié aux dérivés
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1165273084 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| | DIS | LU2337050632 | Oui | Oui | | |
| Catégorie C | CAP | LU1165273241 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| | DIS | LU2337050632 | Oui | Oui | | |
| Catégorie D | CAP | LU1670611257 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1329510710 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neufelize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 0,60% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,35% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,35% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,35% | - | - | 0,18% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds
sous son nom abrégé ABN AMRO Blackrock Euro Government ESG Bonds

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Ce compartiment a été lancé le 25 mai 2016. La « Catégorie A » de distribution a été lancée le 25 juin 2021.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds **sous son nom abrégé ABN AMRO RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds**

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme en maintenant un écart de suivi inférieur à 3 % en s'exposant principalement au marché consolidé des obligations européennes et en ayant recours de manière extensive aux dérivés de taux d'intérêt et aux futures d'obligations à court terme. Le compartiment utilise une sélection de titres respectant les critères de responsabilité environnementaux, sociaux et de gouvernance (« ESG »). Le portefeuille est composé d'émetteurs qui sont soit des leaders dans les bonnes pratiques ESG, soit attractifs en raison de leur progression sur les questions ESG.

Politique d'investissement

La stratégie du compartiment dépend des convictions du Gestionnaire d'investissement et vise à investir principalement dans des obligations d'entreprises de qualité investment grade libellées en euro émises par des sociétés situées dans des pays de la zone euro et dans des obligations de qualité investment grade et des titres considérés comme des produits équivalents aux obligations tels que des obligations à revenu fixe et à taux variable, libellés en euro émis ou garantis par des États membres de l'Union européenne appartenant à la zone euro. Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le compartiment peut également, dans une large mesure, avoir recours à une variété (i) d'instruments dont, entre autres, des contrats à terme de taux, des contrats de change à terme (incluant les contrats de change à terme non livrables), des futures de taux d'intérêt, des futures d'obligations et des swaps négociés de gré à gré tels que des swaps de taux d'intérêt et des swaps de défaut de crédit, et (ii) de stratégies axées notamment sur l'anticipation des fluctuations de taux, le positionnement sur la courbe de rendements, la sélection des émetteurs, la valeur relative et les devises.

Une exposition régulière aux marchés émergents et aux titres à haut rendement peut également être recherchée.

L'allocation d'actifs minimum sur une base consolidée (investissements directs et indirects via l'utilisation d'instruments dérivés) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment.

Les restrictions suivantes s'appliquent au compartiment :

| | |
|--|--|
| - Exposition maximale aux titres à revenu fixe d'émetteurs européens situés en dehors de la zone euro : | 20% |
| - Exposition maximale aux titres à revenu fixe d'émetteurs non européens situés dans des pays développés : | 20% |
| - Exposition maximale aux obligations convertibles : | 20% |
| - Exposition maximale aux titres à haut rendement et aux marchés émergents : | 30% |
| - Exposition maximale aux Instruments du marché monétaire : | 30% |
| - Exposition maximale aux titres non notés : | 10% |
| - Exposition maximale aux titres adossés à des actifs (ABS)/titres adossés à des crédits hypothécaires (MBS) : | 20% |
| - Duration : | +/- 2 ans (comparé au Portefeuille de référence) |
| - Exposition maximale au risque de change : | 10% |
| - Allocation maximale aux actions : | 10% |

L'allocation aux actions sera le résultat de la conversion des obligations convertibles en actions. Le gestionnaire n'est pas autorisé à acheter activement des titres de capital.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs, mais peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des Actifs « distressed » (en difficulté).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 90 % du portefeuille.

Le processus de sélection ESG (exclusions et filtres ESG) entraînera la suppression des investissements d'au moins 20 % de l'univers initial, car ces investissements ne seront pas éligibles (exclusions, niveau des notations ESG).

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds **sous son nom abrégé ABN AMRO RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds**

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) à des fins d'investissement, de couverture et de gestion efficace de portefeuille ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Le niveau d'effet de levier prévu du compartiment selon la méthode de calcul de la somme des montants notionnels ne dépassera généralement pas 1 500 % de la valeur nette d'inventaire du compartiment. Lorsque le calcul exclut les contrats de taux d'intérêt à court terme, le niveau d'effet de levier prévu du compartiment ne dépassera généralement pas 300 % de la valeur nette d'inventaire du compartiment. Ces contrats impliquent généralement des positions importantes et des valeurs notionnelles élevées.

Des niveaux aussi élevés d'effet de levier découlent principalement des dérivés de taux d'intérêt à court terme, mais également du recours aux futures d'obligations cotés à court terme (3 mois) afin d'augmenter ou de réduire la durée du portefeuille d'une durée équivalente à 3 ans, tout en restant dans les limites de la durée globale du portefeuille de +/- 2 ans comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2. Une telle stratégie d'investissement en dérivés, impliquant une valeur notionnelle élevée, peut entraîner un effet de levier beaucoup plus important selon la méthode de calcul de la somme des montants notionnels, notamment lors du recours à des instruments à court terme à des fins de gestion de la durée, tel que prévu pour ce compartiment, dont le profil de risque global devrait rester le même ou n'augmenter que de manière modérée suite à l'utilisation de tels instruments.

Le niveau d'effet de levier variera en fonction du positionnement du compartiment et peut, dans certaines circonstances (par exemple : dans des environnements de marché où le compartiment investit davantage dans des instruments à valeur notionnelle élevée, tels que des dérivés de taux d'intérêt et des futures d'obligation à court terme afin de poursuivre la stratégie d'investissement susvisée), dépasser les niveaux susmentionnés selon le type d'instruments utilisés et leur échéance.

La méthode de calcul de la somme des montants notionnels ne permet pas de compenser les transactions de couverture et autres stratégies d'atténuation des risques impliquant des dérivés, telles que la couverture de change, la gestion de la durée et la macro-couverture. Par conséquent, le niveau d'effet de levier réel peut dépasser et parfois de manière considérable, l'effet de levier économique prévu pour le compartiment.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

RBC Global Asset Management (UK) Limited

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de crédit
- Risque lié aux dérivés
- Risque lié à un effet de levier élevé
- Risque de contrepartie
- Risques liés aux obligations à haut rendement
- Risque de liquidité
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds sous son nom abrégé ABN AMRO RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU2054453076 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU2054453159 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie D | CAP | LU2054453233 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU2054453316 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neufelize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 0,70% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---------------------------|--------------------------------|---|------------------------------|
|---------------------------|--------------------------------|---|------------------------------|

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds
sous son nom abrégé ABN AMRO RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

| | | | |
|---|--------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |
|---|--------------------------|--|---|

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 4 juin 2020.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

sous son nom abrégé ABN AMRO RBC BlueBay Euro Government Bonds

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation de la croissance du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'obligations d'État libellées en euro, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

La stratégie du compartiment dépend des convictions du Gestionnaire d'investissement et vise à investir dans des obligations et des titres considérés comme des produits équivalents aux obligations, tels que des obligations à revenu fixe et à taux variable, de qualité investment grade, libellés en euro et émis ou garantis par un État membre de l'Union européenne appartenant à la zone euro ainsi que dans des dérivés de ce type d'actifs. Le compartiment allouera un minimum de 60 % de ses actifs nets à de tels titres.

Le portefeuille peut également investir dans des obligations et des titres considérés comme des produits équivalents aux obligations, tels que des obligations à revenu fixe et à taux variable, dans d'autres titres à taux fixe ou variable, de qualité investment grade, libellés en euro ou non libellés en euro, et émis ou garantis par un État situé en dehors de la zone euro, ainsi que dans des dérivés de ce type d'actifs, en incluant les marchés émergents et les titres à haut rendement si l'émetteur fait partie du Portefeuille de référence.

Les restrictions suivantes s'appliquent au compartiment :

- Exposition maximale aux titres à revenu fixe de qualité investment grade émis par des entités domiciliées dans des pays situés en dehors de l'Union européenne, dont la dette souveraine à long terme est de qualité investment grade 35 %
- Exposition maximale aux obligations d'entreprises garanties par un émetteur public 20 %
- Exposition maximale aux obligations à haut rendement 15 %
- Exposition maximale aux obligations des marchés émergents 10 %
- Exposition maximale aux obligations garanties 5 %
- Exposition maximale au risque de change (au niveau global) 5 %
- Duration +/- 2 ans (par rapport au Portefeuille de référence)
- Émetteurs asiatiques (y compris la Russie, le Moyen-Orient et le Pacifique) Interdits
- Allocation aux actions Interdite

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs et/ou des Actifs « distressed » (en difficulté).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 70 % du portefeuille.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % du total de ses actifs nets dans des Fonds passifs externes et/ou des ETF qui relèvent de l'article 6 du règlement SFDR. Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) ;

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds **sous son nom abrégé ABN AMRO RBC BlueBay Euro Government Bonds**

- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Le niveau d'effet de levier prévu du compartiment selon la méthode de calcul de la somme des montants notionnels ne dépassera généralement pas 1 500 % de la valeur nette d'inventaire du compartiment. Lorsque le calcul exclut les contrats de taux d'intérêt à court terme, le niveau d'effet de levier prévu du compartiment ne dépassera généralement pas 300 % de la valeur nette d'inventaire du compartiment. Ces contrats impliquent généralement des positions importantes et des valeurs notionnelles élevées.

Des niveaux aussi élevés d'effet de levier découlent principalement des dérivés de taux d'intérêt à court terme, mais également du recours aux futures d'obligations cotés à court terme (3 mois) afin d'augmenter ou de réduire la durée du portefeuille d'une durée équivalente à 3 ans, tout en restant dans les limites de la durée globale du portefeuille de +/- 2 ans comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2. Une telle stratégie d'investissement en dérivés, impliquant une valeur notionnelle élevée, peut entraîner un effet de levier beaucoup plus important selon la méthode de calcul de la somme des montants notionnels, notamment lors du recours à des instruments à court terme à des fins de gestion de la durée, tel que prévu pour ce compartiment, dont le profil de risque global devrait rester le même ou n'augmenter que de manière modérée suite à l'utilisation de tels instruments.

Le niveau d'effet de levier variera en fonction du positionnement du compartiment et peut, dans certaines circonstances (par exemple : dans des environnements de marché où le compartiment investit davantage dans des instruments à valeur notionnelle élevée, tels que des dérivés de taux d'intérêt et des futures d'obligation à court terme afin de poursuivre la stratégie d'investissement susvisée), dépasser les niveaux susmentionnés selon le type d'instruments utilisés et leur échéance.

La méthode de calcul de la somme des montants notionnels ne permet pas de compenser les transactions de couverture et autres stratégies d'atténuation des risques impliquant des dérivés, telles que la couverture de change, la gestion de la durée et la macro-couverture. Par conséquent, le niveau d'effet de levier réel peut dépasser et parfois de manière considérable, l'effet de levier économique prévu pour le compartiment.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

RBC Global Asset Management (UK) Limited

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque lié aux dérivés
- Risque de durabilité
- Risque lié à un effet de levier élevé

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds sous son nom abrégé ABN AMRO RBC BlueBay Euro Government Bonds

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU2757516773 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| | DIS | LU2757516690 | Oui | Oui | | |
| Catégorie G | DIS | LU2757516427 | Oui | Non | Investisseurs clients de la Gestion de portefeuille discrétionnaire des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et ayant conclu un accord de commissions spécifique et investisseurs autorisés | 5,000 EUR |
| Catégorie R | CAP | LU2757518803 | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU2757518985 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires et OPC | 1,000,000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 0.60% | - | - | 0.18% | 0.05% |
| Catégorie G | 0.35% | - | - | 0.18% | 0.01% |
| Catégorie R | 0.35% | - | - | 0.18% | 0.05% |
| Catégorie I | 0.30% | - | - | 0.18% | 0.01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5.00% | 1.00% | 1.00% |
| Catégorie G | 5.00% | 1.00% | 1.00% |
| Catégorie R | 5.00% | 1.00% | 1.00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds
sous son nom abrégé ABN AMRO RBC BlueBay Euro Government Bonds

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment sera lancé à une date non encore déterminée par le Conseil d'administration.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

sous son nom abrégé ABN AMRO Boston Common US Sustainable Equities

ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions américaines durables, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi. Le compartiment utilise une combinaison d'indicateurs financiers et extra-financiers pour identifier les titres qui répondent aux critères de durabilité globale appliqués par le Gestionnaire d'investissement externe.

Le compartiment sera composé de sociétés exposées à trois thèmes durables à long terme, tels que (i) « Changement climatique et renouvellement de la terre », (ii) « Inclusion et autonomisation » et (iii) « Santé et bien-être de la communauté », tout en offrant une appréciation du capital à long terme. L'objectif d'investissement durable du compartiment est de s'aligner sur l'Accord de Paris, dans lequel les gouvernements mondiaux s'engagent à limiter la hausse de la température mondiale à 2 °C par rapport aux niveaux préindustriels. En outre, dans le cadre de son objectif d'investissement socialement durable, le compartiment investit dans des sociétés contribuant positivement aux solutions sociales.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières tels que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières, de sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique en Amérique du Nord.

L'allocation d'actifs minimum sur une base consolidée (investissements directs et indirects via l'utilisation d'instruments dérivés) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % en ADR/GDR.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds conformes à l'article 9 du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers et qui ont été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment peut également investir dans des titres de créance (tels que des obligations à taux fixe et variable, des Instruments du marché monétaire, y compris des obligations à haut rendement) à concurrence de 10 % de ses actifs nets, notamment à des fins de gestion de trésorerie.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment contribue aux objectifs environnementaux et sociaux et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 9 du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers.

L'analyse extra-financière couvre 100 % du portefeuille (la trésorerie n'est pas couverte par l'analyse ESG).

Le processus de sélection ESG (exclusions et filtres ESG) entraînera la suppression des investissements d'au moins 20 % de l'univers initial, car ces investissements ne seront pas éligibles (exclusions, niveau des notations ESG).

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 9. Par ailleurs, le Gestionnaire d'investissement externe n'investit pas dans des sociétés qui ont une implication stratégique dans le nucléaire. En parallèle, le Gestionnaire d'investissement externe a pour objectif d'éviter d'investir dans des sociétés principalement engagées dans l'extraction l'exploration, la production, la fabrication ou le raffinage des combustibles fossiles, mais il peut investir dans des sociétés qui utilisent de l'énergie à base de combustibles fossiles comme intrants dans leurs activités ou qui distribuent des combustibles fossiles. En outre, les sociétés qui génèrent plus de 5 % de leurs revenus à partir de produits/services dangereux ou indésirables sont exclues. Les sociétés qui enfreignent de manière flagrante les réglementations, qui font preuve de négligence, qui ont constamment de mauvais bilans ESG, qui ont déjà eu recours de manière délibérée au travail forcé ou au travail des enfants, qui s'engagent dans des pratiques marketing irresponsables ou dont le bilan en matière de comportement mesurable se détériore, sont également écartées. Les sociétés du secteur des services publics qui produisent de l'électricité à partir de i. plus de 10 % de charbon, ii. plus de 30 % de pétrole et de gaz, iii. plus de 30 % d'énergie nucléaire, sont également écartées.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Boston Common US Sustainable Equities

Instruments dérivés

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des instruments dérivés et autres instruments financiers tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral à des fins d'investissement, de gestion efficace de portefeuille ou de couverture.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Boston Common Asset Management, LLC

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque lié aux bons de souscription
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|------------------|----------------|--|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU2036697717 « Catégorie A-EUR » LU2036799398 « Catégorie A-USD » | Oui | Non | Tous | 100 EUR 100 USD |
| Catégorie AH EUR | CAP | LU2276928715 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie R | CAP | LU2276928558 « Catégorie R-EUR » LU2276928632 « Catégorie R-USD » | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR 100 USD |
| Catégorie RH EUR | CAP | LU2508426785 | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU2036801392 « Catégorie C-EUR » LU2199262432 « Catégorie C-USD » | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR 5 000 USD |
| Catégorie D | CAP | LU2036801558 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |

ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Boston Common US Sustainable Equities

| | | | | | | |
|--------------|-----|--|-----|-----|--|--------------------------------|
| Catégorie F | CAP | LU2036801715 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neuflyze OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU2276928475 « Catégorie I-EUR » LU2276928392 « Catégorie I-USD » | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires et OPC | 1 000 000 EUR 1 000 000 USD |
| | DIS | LU2474253494 « Catégorie I-USD » | | Oui | | 1 000 000 USD |
| Catégorie IH | CAP | LU2474253221 « Catégorie IH-EUR » | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires et OPC | 1 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Boston Common US Sustainable Equities

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|----------------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégories A, AH EUR | 1,50% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie R | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie RH | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie I | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |
| Catégorie IH | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|----------------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégories A, AH EUR | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie R | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie RH | 5,00% | 5,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |
| Catégorie IH | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'USD est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En USD pour les catégories suivantes : « Catégorie A-USD », « Catégorie R-USD », « Catégorie C-USD » et « Catégorie I-USD ». En EUR pour les catégories suivantes : « Catégorie A-EUR », « Catégorie AH-EUR », « Catégorie R-EUR », « Catégorie RH-EUR », « Catégorie C-EUR », « Catégorie D », « Catégorie F », « Catégorie I-EUR » et « Catégorie IH-EUR ».

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 13 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 28 mai 2020.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities **sous son nom abrégé ABN AMRO Boston Common Emerging Markets ESG Equities**

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions des marchés émergents, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives ou les bons de souscription de valeurs mobilières émises par des sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique dans les marchés émergents.

L'allocation d'actifs minimum sur une base consolidée (investissements directs et indirects via l'utilisation d'instruments dérivés) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment peut également investir dans des titres de créance (tels que des obligations à taux fixe et variable, des Instruments du marché monétaire, y compris des obligations à haut rendement) à concurrence de 10 % de ses actifs nets, notamment à des fins de gestion de trésorerie. Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des actions chinoises (Actions A), libellées en CNH, qui sont cotées sur la Bourse de Hong Kong via le Shanghai-Hong Kong et Shenzhen Stock Connect.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers.

Toutes les participations directes dans des obligations d'entreprises et souveraines font l'objet d'une analyse extra-financière.

Le processus de sélection ESG (exclusions et filtres ESG) entraînera la suppression des investissements d'au moins 20 % de l'univers initial, car ces investissements ne seront pas éligibles (exclusions, niveau des notations ESG).

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des instruments dérivés et autres instruments financiers, dont, entre autres, les futures d'indices et les contrats de change à terme, tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral à des fins d'investissement, de gestion efficace de portefeuille ou de couverture.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Boston Common Asset Management, LLC

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque opérationnel et risque de conservation

**ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Boston Common Emerging Markets ESG Equities**

- Risque lié aux marchés émergents
- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risque lié aux bons de souscription
- Risque de durabilité
- Risques spécifiques liés aux investissements en Chine.

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|-----------------------------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU2757516344 "Catégorie A-EUR" | Oui | Non | Tous | EUR 100 |
| | | LU2757518712 "Catégorie A-USD" | | | | USD 100 |
| Catégorie G | CAP | LU2757518639 "Catégorie G-EUR" | Oui | Non | Investisseurs clients de la Gestion de portefeuille discrétionnaire des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et ayant conclu un accord de commissions spécifique et investisseurs autorisés | EUR 5,000 |
| | | LU2757518555 "Catégorie G-USD" | | | | USD 5,000 |
| Catégorie R | CAP | LU2757518472 | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | EUR 100 |
| Catégorie I | CAP | LU2757518126 "Catégorie I-EUR" | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires et OPC | EUR 1,000,000 |
| | DIS | LU2757517821 | | Oui | | USD 1,000,000 |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 2.00% | - | - | 0.25% | 0.05% |
| Catégorie G | 1.10% | - | - | 0.25% | 0.01% |
| Catégorie R | 1.10% | - | - | 0.25% | 0.05% |
| Catégorie I | 1.00% | - | - | 0.20% | 0.01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

**ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Boston Common Emerging Markets ESG Equities**

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5.00% | 1.00% | 1.00% |
| Catégorie G | 5.00% | 1.00% | 1.00% |
| Catégorie R | 5.00% | 1.00% | 1.00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'USD est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En USD pour les catégories suivantes : « Catégorie A-USD », « Catégorie G-USD » et « Catégorie I-USD ».

En EUR pour les catégories suivantes : « Catégorie A-EUR », « Catégorie R », « Catégorie G-EUR » et « Catégorie I-EUR ».

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+3) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment sera lancé à une date non encore déterminée par le Conseil d'administration.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities **sous son nom abrégé ABN AMRO Boston Trust Walden US ESG Equities**

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions durables américaines, en sélectionnant des sociétés qui respectent les critères de responsabilité environnementale, sociale et de gouvernance, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières tels que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières, de sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique en Amérique du Nord.

Le compartiment est géré selon une approche exclusive axée sur la recherche fondamentale ESG et est complété par une approche d'engagement. Il investit dans un portefeuille diversifié d'actions tout en tenant compte des facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance. La philosophie se concentre sur les perspectives à long terme d'une entreprise plutôt que sur les résultats à court terme.

L'allocation d'actifs minimum sur une base consolidée (investissements directs et indirects via l'utilisation d'instruments dérivés) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % en ADR/GDR.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment peut également investir dans des titres de créance (tels que des obligations à taux fixe et variable, des Instruments du marché monétaire, y compris des obligations à haut rendement) à concurrence de 10 % de ses actifs nets, notamment à des fins de gestion de trésorerie.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers.

L'analyse de durabilité couvre 100 % des titres en portefeuille (la trésorerie et les dépôts ne sont pas couverts par l'analyse ESG). Après la mise en œuvre des filtres de durabilité (exclusions et notation ESG), plus de 20 % des titres sont retirés de l'univers initial.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des instruments dérivés et autres instruments financiers tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral à des fins d'investissement, de gestion efficace de portefeuille ou de couverture.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

La méthode de calcul du Portefeuille de référence est disponible sur le site Internet suivant : www.msci.com.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

| |
|--|
| <p style="text-align: center;">ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Boston Trust Walden US ESG Equities</p> |
|--|

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Boston Trust Walden Inc.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque lié aux bons de souscription
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Boston Trust Walden US ESG Equities

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|------------------|----------------|--|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU2281294533 « Catégorie A-EUR » LU2281294616 « Catégorie A-USD » | Oui | Non | Tous | 100 EUR 100 USD |
| | DIS | LU2281294707 « Catégorie A-GBP » | | Oui | | 100 GBP |
| Catégorie AH EUR | CAP | LU2281294889 | | Non | | 100 EUR |
| Catégorie R | CAP | LU2281294962 « Catégorie R-EUR » LU2281295001 « Catégorie R-USD » | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR 100 USD |
| | DIS | LU2281295183 « Catégorie R-GBP » | | Oui | | 100 GBP |
| Catégorie RH EUR | CAP | LU2281295423 | | Non | | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU2281295696 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie D | CAP | LU2281295779 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU2281295852 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neulize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU2281295936 « Catégorie I-EUR » LU2281296074 « Catégorie I-USD » | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires et OPC | 1 000 000 EUR 1 000 000 USD |
| | | | | | | Catégorie IH EUR |
| Catégorie Z | CAP | LU2281296405 | Oui | Non | Investisseurs autorisés | 100 000 000 USD |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Boston Trust Walden US ESG Equities

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|----------------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégories A, AH EUR | 1,50 % | - | - | 0,18 % | 0,05 % |
| Catégories R, RH EUR | 0,85 % | - | - | 0,18 % | 0,05 % |
| Catégorie C | 0,85 % | - | - | 0,18 % | 0,05 % |
| Catégorie D | 0,85 % | - | - | 0,18 % | 0,05 % |
| Catégorie F | 0,85 % | - | - | 0,18 % | 0,01 % |
| Catégories I, IH EUR | 0,75 % | - | - | 0,15 % | 0,01 % |
| Catégorie Z | 0,00 % | - | - | 0,15 % | 0,01 % |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|----------------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégories A, AH EUR | 5,00 % | 1,00 % | 1,00 % |
| Catégories R, RH EUR | 5,00 % | 1,00 % | 1,00 % |
| Catégorie C | 5,00 % | 1,00 % | 1,00 % |
| Catégorie D | 5,00 % | 1,00 % | 1,00 % |
| Catégorie F | 5,00 % | 1,00 % | 1,00 % |
| Catégories I, IH EUR | - | - | - |
| Catégorie Z | 5,00 % | 1,00 % | 1,00 % |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'USD est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En USD pour les catégories suivantes : « Catégorie A-USD », « Catégorie R-USD », « Catégorie I-USD » et « Catégorie Z ».

En EUR pour les catégories suivantes : « Catégorie A-EUR », « Catégorie AH EUR », « Catégorie R-EUR », « Catégorie RH EUR », « Catégorie C », « Catégorie D », « Catégorie F », « Catégorie I-EUR » et « Catégorie IH EUR ».

En GBP pour les catégories suivantes : « Catégorie A-GBP » et « Catégorie R-GBP ».

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 13 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Boston Trust Walden US ESG Equities

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 1^{er} juillet 2023.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam Emerging Markets ESG Bonds

ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'obligations des marchés émergents durables, sans aucune restriction spécifique sur l'écart de suivi. Le compartiment utilise une sélection de titres respectant les critères de responsabilité environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG). Le portefeuille est composé d'émetteurs qui sont soit des leaders dans les bonnes pratiques ESG, soit attractifs en raison de leur progression sur les questions ESG.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des titres de créance d'émetteurs (qui ne sont soumis à aucune contrainte en matière de notation) situés, ayant leur siège social, ou exerçant une part prépondérante de leur activité économique dans des pays émergents.

Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le compartiment peut également avoir recours à une variété (i) d'instruments dont, entre autres, des contrats à terme de taux, des contrats de change à terme (incluant les contrats de change à terme non livrables), des futures de taux d'intérêt, des futures d'obligations et des swaps négociés de gré à gré tels que des swaps de taux d'intérêt et des swaps de défaut de crédit, et (ii) de stratégies axées, notamment, sur l'anticipation des fluctuations de taux, le positionnement sur la courbe de rendements, la sélection des émetteurs, la valeur relative et les devises.

L'univers d'investissement du compartiment comprend les titres de créance en devises locale et forte.

L'allocation d'actifs minimum sur une base consolidée (investissements directs et indirects via l'utilisation d'instruments dérivés) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment sera tenu, pour les 40 % du total de ses actifs nets restants et sur une base consolidée, de respecter toutes les limitations établies au regard des investissements en titres/instruments mentionnés ci-dessous :

(i) 25 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des obligations convertibles et autres titres de créance liés à des actions ;

(ii) un tiers maximum du total des actifs nets du compartiment peut être investi dans des instruments du marché monétaire, dont, entre autres, des certificats de dépôt, des dépôts à court terme et des dépôts bancaires à vue ;

(iii) 10 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des valeurs mobilières ;

(iv) 10 % maximum des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

L'allocation aux actions sera le résultat de la conversion des obligations convertibles en actions. Le gestionnaire n'est pas autorisé à acheter activement des titres de capital.

Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs, mais peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des Actifs « distressed » (en difficulté).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers.

Toutes les participations directes dans des obligations d'entreprises et souveraines font l'objet d'une analyse extra-financière.

Le processus de sélection ESG (exclusions et filtres ESG) entraînera la suppression des investissements d'au moins 20 % de l'univers initial, car ces investissements ne seront pas éligibles (exclusions, niveau des notations ESG).

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) à des fins d'investissement, de couverture et de gestion efficace de portefeuille ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

La méthode de calcul du Portefeuille de référence est disponible sur le site Internet suivant : www.jpmorgan.com.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Candriam délègue ses tâches de gestion de portefeuille à la succursale britannique de Candriam.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque de taux d'intérêt
- Risque de change
- Risques liés aux obligations à haut rendement
- Risque de liquidité
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|------------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie AH USD | CAP | LU2041742292 | Oui | Non | Tous | 100 USD |
| Catégorie A | CAP | LU2041742375 | | | | 100 EUR |
| Catégorie CH USD | CAP | LU2041742458 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 USD |
| Catégorie C | CAP | LU2041742615 | Oui | Non | | 5 000 EUR |
| | DIS | LU2041742706 | | Oui | | |
| Catégorie D | DIS | LU2041742961 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU2041743001 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neufelize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|----------------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégories A, AH USD | 1,30% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégories C, CH USD | 0,75% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégorie D | 0,75% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégorie F | 0,75% | - | - | 0,25 % | 0,01% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription ⁽²⁾ | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat ⁽²⁾ |
|----------------------|---|---|-------------------------------------|
| Catégories A, AH USD | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégories C, CH USD | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En USD pour les catégories suivantes : « Catégorie AH-USD » et « Catégorie CH-USD »

En EUR pour les catégories suivantes : « Catégorie A », « Catégorie C », « Catégorie D » et « Catégorie F »

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds
sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 25 février 2020.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam Euro ESG Short Term Bonds

ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à court terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'obligations durables à court terme, sans aucune restriction spécifique sur l'écart de suivi. Le compartiment utilise une sélection de titres respectant les critères de responsabilité environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG). Le portefeuille est composé d'émetteurs qui sont soit des leaders dans les bonnes pratiques ESG, soit attractifs en raison de leur progression sur les questions ESG.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des obligations et des titres considérés comme des produits équivalents aux obligations tels que des obligations à revenu fixe et à taux variable, libellés en euro dont l'échéance moyenne n'excède pas 3 ans (et dont l'échéance résiduelle de chaque investissement ne dépasse pas 6 ans) ainsi que dans des dérivés de ce type d'actifs. Pour les obligations à taux variable, la date suivante d'ajustement du taux retenue est la date d'échéance. Le compartiment allouera un minimum de 60 % de ses actifs nets à de tels titres.

Le compartiment sera tenu, pour les 40 % du total de ses actifs nets restants et sur une base consolidée, de respecter toutes les limitations établies au regard des investissements en titres/instruments mentionnés ci-dessous (sur la base de l'actif net total du compartiment) :

- (i) un maximum de 40 % peut être investi dans des instruments du marché monétaire et des dépôts bancaires à vue ;
- (ii) un maximum de 10 % peut être investi dans des obligations à haut rendement ;
- (iii) un maximum de 10 % peut être investi dans d'autres OPCVM ou OPC.

Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs, mais peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des Actifs « distressed » (en difficulté).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers.

Toutes les participations directes dans des obligations d'entreprises et souveraines font l'objet d'une analyse extra-financière.

Le processus de sélection ESG (exclusions et filtres ESG) entraînera la suppression des investissements d'au moins 20 % de l'univers initial, car ces investissements ne seront pas éligibles (exclusions, niveau des notations ESG).

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes avec la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt [swap note futures] et les futures de change).
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

La méthode de calcul du Portefeuille de référence est disponible sur le site Internet suivant : www.euribor-rates.eu.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Gestionnaire d'investissement externe

Candriam

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque de crédit
- Risque lié aux dérivés
- Risque de taux d'intérêt
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1670612651 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| | DIS | LU2325352701 | Oui | Oui | | |
| Catégorie R | CAP | LU1670612735 | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU1670612818 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| | DIS | LU2112790014 | | | | |
| Catégorie D | CAP | LU1670612909 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1670613030 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neuflyze OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU1670613113 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 0,40% | - | - | 0,12% | 0,05% |
| Catégorie R | 0,25 % | - | - | 0,12% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,25 % | - | - | 0,12% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,25 % | - | - | 0,12% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,25 % | - | - | 0,12% | 0,01% |
| Catégorie I | 0,20% | - | - | 0,12% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie R | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée.

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Inscription à la cote :

Néant

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 3 décembre 2019. La « Catégorie A » de distribution a été lancée le 9 juillet 2021.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Convertibles

sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam European ESG Convertibles

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Convertibles

Objectif d'investissement

Fournir une croissance du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'obligations convertibles européennes durables, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi et en sélectionnant des titres respectant les critères de responsabilité environnementaux, sociaux et de gouvernance (« ESG »). Le portefeuille est composé d'émetteurs qui sont soit des leaders dans les bonnes pratiques ESG, soit attractifs en raison de leur progression sur les questions ESG.

Politique d'investissement

Le compartiment est activement géré par une analyse de la liquidité, puis par une approche fondamentale descendante, issue de trois comités différents qui examinent le revenu fixe, l'allocation d'actifs et les points de vue économiques (à savoir le « Comité stratégique du revenu fixe », le « Comité d'allocation d'actifs » et le « Comité des perspectives économiques ») qui se réunissent tous les mois.

Le Comité des perspectives économiques présente une analyse à jour du contexte économique et financier et des prévisions y associées, en mettant l'accent sur les risques entourant les différents scénarios. Le Comité stratégique du revenu fixe tire parti de la stratégie obligataire et de l'allocation d'actifs à partager avec les équipes internes. Le Comité d'allocation d'actifs décide d'une allocation d'actifs optimale. Chaque comité compte des responsables des différentes unités opérationnelles et du Directeur de l'information au sein de Candriam.

Enfin, la construction du portefeuille est effectuée en prêtant attention au risque de concentration par émetteur, secteur et région, et à la gestion active du delta. Le compartiment investit principalement dans des obligations convertibles et des obligations convertibles synthétiques cotées sur le marché européen.

Pour atteindre son objectif d'investissement, le compartiment peut également utiliser d'autres instruments, par exemple des instruments du marché monétaire, des instruments de créance et des instruments dérivés (tels que les contrats de change à terme, les futures, les options, les bons de souscription et les swaps) afin d'obtenir des expositions longue et courte.

Les obligations convertibles représentent une exposition minimum de 55 % et une exposition maximum de 110 % des actifs nets du compartiment, cette part de 10 % d'effet de levier provenant de l'utilisation de dérivés.

Le compartiment respecte également les restrictions d'investissement suivantes :

- (i) un maximum de 25 % est investi dans des instruments de créance ordinaires (obligations et EMTN simples), à l'exclusion de la part constituée d'obligations convertibles synthétiques, sans contraintes en matière de notation ou de sensibilité particulière aux taux d'intérêt ;
- (ii) un maximum de 10 % est investi en actions ;
- (iii) un maximum de 10 % est investi dans des OPCVM français ou européens et d'autres OPC ou FIA (fonds d'investissement alternatif).

Le compartiment peut chercher (i) à concentrer son portefeuille sur un nombre limité d'actifs tout en respectant les limites de diversification de la Loi et de la Directive 2009/65 et (ii) à obtenir une exposition aux actifs assortis d'un risque de crédit (à l'exception toutefois des investissements non productifs et/ou des Actifs « distressed » [en difficulté]).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers.

L'analyse ESG du gestionnaire couvre au moins 90 % des investissements du fonds. La part des actifs « sans note ESG » dans le portefeuille ne doit pas dépasser 10 % de l'actif net.

Le processus de sélection ESG (exclusions et filtres ESG) entraînera la suppression des investissements d'au moins 20 % de l'univers initial, car ces investissements ne seront pas éligibles (exclusions, niveau des notations ESG).

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut en dernier temps minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Convertibles **sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam European ESG Convertibles**

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Candriam.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque lié aux marchés d'actions
- Risque lié aux dérivés
- Risque de contrepartie
- Risque de crédit
- Risque de taux d'intérêt
- Risque de perte sur le capital
- Risque de liquidité
- Risque de volatilité
- Risque de change
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque lié aux bons de souscription
- Risque de durabilité.

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Instruments dérivés

Afin de réaliser son objectif d'investissement, le compartiment peut utiliser des instruments dérivés, par exemple :

- Options sur actions et sur indices d'actions ;
- Options sur taux d'intérêt et swaps de taux d'intérêt ;
- futures d'actions, futures d'indices d'actions, dérivés de crédit, futures d'obligations d'État et futures de taux d'intérêt ;
- Bons de souscription ;
- Contrats à terme de gré à gré.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Étant donné que le compartiment est susceptible d'investir dans un portefeuille d'actifs relativement concentré et dans des actifs assortis d'un risque de crédit, nous attirons l'attention des investisseurs sur le fait que les risques de liquidité et de crédit du compartiment peuvent être supérieurs à ceux d'autres fonds convertibles similaires.

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Convertibles
sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam European ESG Convertibles

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1406018025 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie R | CAP | LU1670608899 | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1406018371 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neuflyze OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU1406018298 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |
| Catégorie X | CAP | LU1406018454 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels et OPC | 20 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance ⁽²⁾ | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|--|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie R | 0,70% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,70% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie I | 0,60% | - | - | 0,15% | 0,01% |
| Catégorie X | 0,50% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription ⁽²⁾ | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat ⁽²⁾ |
|-------------|---|---|-------------------------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie R | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |
| Catégorie X | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Convertibles
sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam European ESG Convertibles

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant.

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 3 décembre 2019.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam European ESG Smaller Companies Equities

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Objectif d'investissement

Fournir une croissance du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions de sociétés européennes plus petites, sans restriction spécifique sur l'écart de suivi. Le compartiment utilise une sélection de titres respectant les critères de responsabilité environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG). Le portefeuille est composé d'émetteurs qui sont soit des leaders dans les bonnes pratiques ESG, soit attractifs en raison de leur progression sur les questions ESG.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières de, sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique en Europe et dont la capitalisation boursière est inférieure au seuil de 15 milliards d'euros (ce chiffre pouvant être ponctuellement ajusté en fonction des conditions de marché). L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. Par ailleurs, le pourcentage minimum d'actions de sociétés établies dans des pays de l'Espace économique européen ayant conclu un accord fiscal avec la France incluant une clause de coopération administrative afin de lutter contre la fraude et l'évasion fiscales correspondra au moins à 75 % des actifs nets du compartiment.

Les investissements en titres de créance n'excéderont pas 15 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales ou sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse ESG du Gestionnaire d'investissement couvre au moins 90 % des investissements du fonds. La part des actifs « sans note ESG » dans le portefeuille ne doit pas dépasser 10 % de l'actif net.

Le processus de sélection ESG (exclusions et filtres ESG) entraînera la suppression des investissements d'au moins 20 % de l'univers initial, car ces investissements ne seront pas éligibles (exclusions, niveau des notations ESG).

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le compartiment peut avoir recours à des positions non complexes sur instruments financiers dérivés ou utiliser des instruments financiers dérivés uniquement à des fins de couverture.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

La méthode de calcul du Portefeuille de référence est disponible sur le site Internet suivant : www.msci.com.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Candriam

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risque opérationnel et risque de conservation
- Risque lié aux bons de souscription

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1890801662 | Oui | Oui | Tous | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU2110838757 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie D | CAP | LU2110838831 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1890801746 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neufelize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU1890801829 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,75% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,95% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,95% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie I | 0,75% | - | - | 0,18% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam European ESG Smaller Companies
Equities

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|---------------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 29 novembre 2019.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities

sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam European ESG Equities

ABN AMRO Funds_Candriam European ESG Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions européennes durables, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi et en sélectionnant des titres respectant les critères de responsabilité environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG). Le portefeuille est composé d'émetteurs qui sont soit des leaders dans les bonnes pratiques ESG, soit attractifs en raison de leur progression sur les questions ESG.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières de, sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique en Europe. La sélection des investissements se fonde sur une combinaison de critères financiers ainsi que sur des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance. L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. Par ailleurs, le pourcentage d'actions de sociétés établies dans des pays de l'Espace économique européen ayant conclu un accord fiscal avec la France incluant une clause de coopération administrative afin de lutter contre la fraude et l'évasion fiscales détenu en propriété correspondra au moins à 75 % des actifs nets du compartiment. Le compartiment pourra investir dans le segment des petites capitalisations à concurrence de 50 % maximum de ses actifs nets.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Les investissements en titres de créance n'excéderont pas 15 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers.

L'analyse ESG du gestionnaire couvre au moins 90 % des investissements du fonds. La part des actifs « sans note ESG » dans le portefeuille ne doit pas dépasser 10 % de l'actif net.

Le processus de sélection ESG (exclusions et filtres ESG) entraînera la suppression des investissements d'au moins 20 % de l'univers initial, car ces investissements ne seront pas éligibles (exclusions, niveau des notations ESG).

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures d'indices d'action et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

La méthode de calcul du Portefeuille de référence est disponible sur le site Internet suivant : www.msci.com.

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam European ESG Equities

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Candriam

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque lié aux bons de souscription
- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1481503974 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie R | CAP | LU1670606414 | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1481504352 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neuflyze OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU1481504196 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |
| Catégorie X | CAP | LU1670606687 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels et OPC | 20 000 000 EUR |
| Catégorie Z | CAP | LU1670606505 | Oui | Non | Investisseurs autorisés | 100 000 000 EUR |
| Catégorie M | CAP | LU1481504279 | Oui | Non | Investisseurs étant des entités nourricières des compartiments de la Société et investisseurs autorisés | 20 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,75% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie R | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie I | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |
| Catégorie X | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |
| Catégorie Z | 0,00% | - | - | 0,15% | 0,01% |
| Catégorie M | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam European ESG Equities

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie R | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |
| Catégorie X | - | - | - |
| Catégorie Z | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie M | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 29 novembre 2019.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities

sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam French ESG Equities

ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions françaises, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi. Le compartiment utilise une sélection de titres respectant les critères de responsabilité environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG). Le portefeuille est composé d'émetteurs qui sont soit des leaders dans les bonnes pratiques ESG, soit attractifs en raison de leur progression sur les questions ESG.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières de, sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique en France. L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. Par ailleurs, le pourcentage d'actions de sociétés établies dans des pays de l'Espace économique européen ayant conclu un accord fiscal avec la France incluant une clause de coopération administrative afin de lutter contre la fraude et l'évasion fiscales détenu en propriété correspondra au moins à 75 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment respecte également les règles de construction suivantes :

- 50 % maximum des actifs nets du compartiment investis dans des actions de petite et moyenne capitalisations
- 10 % maximum des actifs nets du compartiment investis dans des actions émergentes et internationales

Les investissements en titres de créance n'excéderont pas 15 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales ou sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse ESG du Gestionnaire d'investissement externe couvre au moins 90 % des investissements du fonds. La part des actifs « sans note ESG » dans le portefeuille ne doit pas dépasser 10 % de l'actif net.

Le processus de sélection ESG (exclusions et filtres ESG) entraînera la suppression des investissements d'au moins 20 % de l'univers initial, car ces investissements ne seront pas éligibles (exclusions, niveau des notations ESG).

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures d'indices d'action et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam French ESG Equities

La méthode de calcul du Portefeuille de référence est disponible sur le site Internet suivant : www.msci.com.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Candriam

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque lié aux bons de souscription

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1481504436 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| | DIS | LU1481504519 | Oui | Oui | | 100 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1481507025 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neulize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU1481504600 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |
| Catégorie M | CAP | LU1481504782 | Oui | Non | Investisseurs étant des entités nourricières des compartiments de la Société et investisseurs autorisés | 20 000 000 EUR |

⁽¹⁾ Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,75% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie I | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |
| Catégorie M | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |

⁽¹⁾ La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |
| Catégorie M | - | - | - |

⁽¹⁾ En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam French ESG Equities

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 18 décembre 2019.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam Global ESG Convertibles

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

Objectif d'investissement

Fournir une croissance du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'obligations convertibles mondiales, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi et en sélectionnant des titres respectant les critères de responsabilité environnementaux, sociaux et de gouvernance (« ESG »). Le portefeuille est composé d'émetteurs qui sont soit des leaders dans les bonnes pratiques ESG, soit attractifs en raison de leur progression sur les questions ESG.

Politique d'investissement

Le compartiment est activement géré par une analyse de la liquidité, puis par une approche fondamentale descendante, issue de trois comités différents qui examinent le revenu fixe, l'allocation d'actifs et les points de vue économiques (à savoir le « Comité stratégique du revenu fixe », le « Comité d'allocation d'actifs » et le « Comité des perspectives économiques ») qui se réunissent tous les mois.

Le Comité des perspectives économiques présente une analyse à jour du contexte économique et financier et des prévisions y associées, en mettant l'accent sur les risques entourant les différents scénarios. Le Comité stratégique du revenu fixe tire parti de la stratégie obligataire et de l'allocation d'actifs à partager avec les équipes internes. Le Comité d'allocation d'actifs décide d'une allocation d'actifs optimale. Chaque comité compte des responsables des différentes unités opérationnelles et du Directeur de l'information au sein de Candriam.

Enfin, la construction du portefeuille est effectuée en prêtant attention au risque de concentration par émetteur, secteur et région, et à la gestion active du delta.

Le compartiment investit principalement dans des obligations convertibles et des obligations convertibles synthétiques admises à la cote sur un marché, quel qu'il soit.

Pour atteindre son objectif d'investissement, le compartiment peut également utiliser d'autres instruments, par exemple des instruments du marché monétaire, des instruments de créance et des instruments dérivés (tels que les contrats de change à terme, les futures, les options, les bons de souscription et les swaps) afin d'obtenir des expositions longue et courte.

Les obligations convertibles représentent une exposition minimum de 55 % et une exposition maximum de 110 % des actifs nets du compartiment, cette part de 10 % d'effet de levier provenant de l'utilisation de dérivés.

Le compartiment respecte également les restrictions d'investissement suivantes :

- (i) un maximum de 25 % est investi dans des instruments de créance ordinaires (obligations et EMTN simples), à l'exclusion de la part constituée d'obligations convertibles synthétiques, sans contraintes en matière de notation ou de sensibilité particulière aux taux d'intérêt ;
- (ii) un maximum de 10 % est investi en actions ;
- (iii) un maximum de 10 % est investi dans des OPCVM français ou européens et d'autres OPC ou FIA (fonds d'investissement alternatif). Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs et/ou des Actifs « distressed » (en difficulté).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers.

L'analyse ESG du gestionnaire couvre au moins 90 % des investissements du fonds. La part des actifs « sans note ESG » dans le portefeuille ne doit pas dépasser 10 % de l'actif net.

Le processus de sélection ESG (exclusions et filtres ESG) entraînera la suppression des investissements d'au moins 20 % de l'univers initial, car ces investissements ne seront pas éligibles (exclusions, niveau des notations ESG).

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam Global ESG Convertibles

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Candriam

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque lié aux marchés d'actions
- Risque lié aux dérivés
- Risque de contrepartie
- Risque de crédit
- Risque de taux d'intérêt
- Risque de perte sur le capital
- Risque de liquidité
- Risque de volatilité
- Risque de change
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque lié aux bons de souscription
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Instruments dérivés

Afin de réaliser son objectif d'investissement, le compartiment peut utiliser des instruments dérivés, par exemple :

- Options sur actions et sur indices d'actions ;
- Options sur taux d'intérêt et swaps de taux d'intérêt ;
- futures d'actions, futures d'indices d'actions, dérivés de crédit, futures d'obligations d'État et futures de taux d'intérêt ;
- Bons de souscription ;
- Contrats à terme de gré à gré.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1406017647 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie R | CAP | LU1670609277 | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1406017993 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neuflyze OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU1406017720 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |
| Catégorie X | CAP | LU1481505243 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels et OPC | 20 000 000 EUR |

⁽¹⁾ Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles
sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam Global ESG Convertibles

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance ⁽²⁾ | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|--|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie R | 0,70% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,70% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie I | 0,60% | - | - | 0,15% | 0,01% |
| Catégorie X | 0,50% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription ⁽²⁾ | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat ⁽²⁾ |
|-------------|---|---|-------------------------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie R | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |
| Catégorie X | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant.

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 18 décembre 2019.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Candriam Global Dividend Equities **sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam Global Dividend Equities**

ABN AMRO Funds Candriam Global Dividend Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation de la croissance du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions mondiales, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

La sélection des investissements se fonde sur une combinaison de critères qualitatifs et quantitatifs. L'objectif de l'analyse quantitative est de détecter les sociétés offrant des dividendes élevés et stables, ainsi que celles présentant une croissance des dividendes pour les années à venir. Le compartiment privilégiera ces deux types de sociétés.

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières de, sociétés situées dans le monde entier (y compris dans les marchés émergents) et de tout secteur économique. L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Les restrictions suivantes s'appliquent au compartiment :

- Exposition maximale aux marchés émergents : 50 %
- Exposition maximale aux sociétés de petite et moyenne capitalisations : 50%

Le compartiment ne sera pas directement exposé aux actions de Chine continentale.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Les investissements en titres de créance n'excèdent pas 15 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

En vertu des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance de ManCo et conformément aux Principes pour l'investissement responsable des Nations Unies, le compartiment exclut tout investissement direct dans des titres émis par des sociétés impliquées dans des activités hautement controversées (telles que la production de tabac et d'armes controversées) et/ou en violation grave des principes du Pacte mondial des Nations Unies.

Instruments dérivés

Le compartiment peut avoir recours à des positions non complexes sur instruments financiers dérivés ou utiliser des instruments financiers dérivés uniquement à des fins de couverture.

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures d'indices d'action et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Candriam

ABN AMRO Funds Candriam Global Dividend Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam Global Dividend Equities

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque opérationnel et risque de conservation
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risque lié aux bons de souscription

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1890802801 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1890803015 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neuflyze OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU1890803288 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,75% | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,85% | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie I | 0,75% | - | 0,18% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

ABN AMRO Funds Candriam Global Dividend Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam Global Dividend Equities

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 3 décembre 2019.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam Global ESG High Yield Bonds

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'obligations mondiales à haut rendement durables, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi. Le compartiment utilise une sélection de titres respectant les critères de responsabilité environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG). Le portefeuille est composé d'émetteurs qui sont soit des leaders dans les bonnes pratiques ESG, soit attractifs en raison de leur progression sur les questions ESG.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement et de manière discrétionnaire dans des titres de créance d'émetteurs à haut rendement situés dans le monde entier.

Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le compartiment peut également avoir recours à une variété (i) d'instruments dont, entre autres, des contrats à terme de taux, des contrats de change à terme (incluant les contrats de change à terme non livrables), des futures de taux d'intérêt, des futures d'obligations et des swaps négociés de gré à gré tels que des swaps de taux d'intérêt et des swaps de défaut de crédit, et (ii) de stratégies axées, notamment, sur l'anticipation des fluctuations de taux, le positionnement sur la courbe de rendements, la sélection des émetteurs, la valeur relative et les devises.

L'allocation d'actifs minimum sur une base consolidée (investissements directs et indirects via l'utilisation d'instruments dérivés) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment sera tenu, pour les 40 % du total de ses actifs nets restants et sur une base consolidée, de respecter toutes les limitations établies au regard des investissements en titres/instruments mentionnés ci-dessous :

- (i) 25 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des obligations convertibles et autres titres de créance liés à des actions ;
- (ii) un tiers maximum du total des actifs nets du compartiment peut être investi dans des Instruments du marché monétaire, dont, entre autres, des certificats de dépôt, des dépôts à court terme et des dépôts bancaires à vue ;
- (iii) 10 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des valeurs mobilières ;
- (iv) 10 % maximum des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

L'allocation aux actions sera le résultat de la conversion des obligations convertibles en actions. Le gestionnaire n'est pas autorisé à acheter activement des titres de capital.

Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs, mais peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des Actifs « distressed » (en difficulté).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers.

Toutes les participations directes dans des obligations d'entreprises et souveraines font l'objet d'une analyse extra-financière. En partant de l'univers OCDE, au moins 20 % de l'univers initial est exclu du côté des entreprises et au moins 20 % du côté des émetteurs souverains.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) à des fins d'investissement, de couverture et de gestion efficace de portefeuille ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam Global ESG High Yield Bonds

gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Candriam

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque de taux d'intérêt
- Risque de change
- Risques liés aux obligations à haut rendement
- Risque de liquidité
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|------------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie AH USD | CAP | LU2041743183 | Oui | Non | Tous | 100 USD |
| Catégorie A | CAP | LU2041743266 | | | | 100 EUR |
| Catégorie R | CAP | LU2254194934 | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| Catégorie CH USD | CAP | LU2041743340 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 USD |
| | DIS | LU2041743423 | | Oui | | 5 000 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU2041743696 | Oui | Non | | 5 000 EUR |
| | DIS | LU2041743779 | | Oui | | |
| Catégorie DH USD | CAP | LU2041743852 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 USD |
| Catégorie D | DIS | LU2041743936 | Oui | Non | | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU2041744074 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neuflyze OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU2254194850 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |

⁽¹⁾ Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds
sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam Global ESG High Yield Bonds

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|----------------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégories A, AH USD | 1,30% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégorie R | 0,75% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégories C, CH USD | 0,75% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégories D, DH USD | 0,75% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégorie F | 0,75% | - | - | 0,25 % | 0,01% |
| Catégorie I | 0,65% | - | - | 0,20% | 0,01% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription ⁽²⁾ | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat ⁽²⁾ |
|----------------------|---|---|-------------------------------------|
| Catégories A, AH USD | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie R | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégories C, CH USD | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégories D, DH USD | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En USD pour les catégories « Catégorie AH-USD », « Catégorie CH-USD » et « Catégorie DH USD ».

En EUR pour les catégories « Catégorie A », « Catégorie R », « Catégorie C », « Catégorie D », « Catégorie F » et « Catégorie I ».

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 14 mai 2020.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Candriam Total Return Global Bonds

sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam Total Return Global Bonds

ABN AMRO Funds Candriam Total Return Global Bonds

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'obligations mondiales, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement et de manière discrétionnaire dans des titres de créance d'émetteurs (qui ne sont soumis à aucune contrainte en matière de notation, notamment dans des obligations à haut rendement) situés dans le monde entier (y compris dans les marchés émergents) et de tout secteur économique. Le compartiment peut également avoir recours à une variété d'instruments (dont, entre autres, des instruments du marché monétaire, des obligations convertibles, des contrats à terme de taux, des contrats de change à terme, incluant les contrats de change à terme non livrables, des futures de taux d'intérêt, des futures d'obligations et des swaps négociés de gré à gré tels que des swaps de taux d'intérêt et des swaps de défaut de crédit). La sélection des titres sera déterminée par des stratégies dont, entre autres, la sensibilité aux taux d'intérêt et les spreads de crédit.

L'investissement en titres de créance et en instruments du marché monétaire peut varier de 0 à 100 % des actifs nets du compartiment.

Les restrictions suivantes s'appliquent au compartiment :

- Exposition maximale aux obligations convertibles : 20 %
- Exposition maximale aux titres de créance à haut rendement et des marchés émergents : 30 %
- Sensibilité : de 0 % à 7 %.
- Exposition maximale au risque de change : 10 %
- Allocation maximale aux actions : 10%

L'allocation aux actions sera le résultat de la conversion des obligations convertibles en actions. Le gestionnaire n'est pas autorisé à acheter activement des titres de capital.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs, mais peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des Actifs « distressed » (en difficulté).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

En vertu des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance de ManCo et conformément aux Principes pour l'investissement responsable des Nations Unies, le compartiment exclut tout investissement direct dans des titres émis par des sociétés impliquées dans des activités hautement controversées (telles que la production de tabac et d'armes controversées) et/ou en violation grave des principes du Pacte mondial des Nations Unies.

Instruments dérivés

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) à des fins d'investissement et de couverture ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le niveau d'engagement généré par les instruments financiers dérivés est limité à 100 % de l'actif net du compartiment. Par conséquent, l'exposition du compartiment variera de 0 à 200 %.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Candriam

ABN AMRO Funds Candriam Total Return Global Bonds sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam Total Return Global Bonds

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de crédit
- Risque lié aux dérivés
- Risque de contrepartie
- Risques liés aux obligations à haut rendement
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque de liquidité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-----------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1890809053 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie A Dis | DIS | LU1890809137 | | Oui | | |
| Catégorie R | CAP | LU1890809301 | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1890809483 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neuflyze OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU1890809566 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,00% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie R | 0,50% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,50% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie I | 0,45% | - | - | 0,18% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie R | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

ABN AMRO Funds Candriam Total Return Global Bonds
sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam Total Return Global Bonds

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 27 novembre 2020.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Candriam Total Return Global Equities

sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam Total Return Global Equities

ABN AMRO Funds Candriam Total Return Global Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation de la croissance du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions mondiales, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement et de manière discrétionnaire dans des actions et des titres connexes, sans aucune restriction quant aux pays (pays émergents compris, hors actions de Chine continentale), aux secteurs et aux devises.

Le compartiment peut également avoir recours à des titres de créance et des Instruments du marché monétaire d'émetteurs (qui ne sont soumis à aucune contrainte en matière de notation) situés dans le monde entier (y compris dans les marchés émergents) et de tout secteur économique. L'investissement en titres de créance et en instruments du marché monétaire peut varier de 0 à 49 % des actifs nets du compartiment.

La gestion du compartiment est active et flexible. Le principal facteur de gestion de portefeuille sera basé sur une allocation en actions (minimum 51 % des actifs nets du compartiment) et le niveau de risque maximal auquel le portefeuille peut être exposé en tant que portefeuille composé exclusivement d'actions.

En fonction de ses prévisions et de ses convictions à l'égard des risques et des opportunités, le gestionnaire de portefeuille sélectionne plusieurs catégories d'actifs, zones géographiques, secteurs et styles de gestion (valeur, combinaison ou croissance des actions). L'allocation sera définie par le biais d'une analyse fondamentale de l'environnement économique et financier. Le gestionnaire de portefeuille décide de l'allocation entre chacun des différents types d'investissements et catégories d'actifs.

L'allocation peut fortement différer de celle du Portefeuille de référence du compartiment.

L'allocation en actions représentera entre 51 % et 100 % des actifs nets du compartiment, sans restriction en matière de capitalisation boursière ou de pays (y compris les pays émergents).

Concernant la stratégie obligataire, la sensibilité de cette stratégie sera comprise entre -4 % et +10 %.

Le compartiment ne sera pas directement exposé aux actions de Chine continentale.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force des Sociétés de gestion, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'elles appliquent. Le processus de sélection quantitative vise à sélectionner uniquement les Fonds d'investissement disposant d'un historique de performance ajusté du risque éprouvé.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

En vertu des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance de ManCo et conformément aux Principes pour l'investissement responsable des Nations Unies, le compartiment exclut tout investissement direct dans des titres émis par des sociétés impliquées dans des activités hautement controversées (telles que la production de tabac et d'armes controversées) et/ou en violation grave des principes du Pacte mondial des Nations Unies.

Instruments dérivés

Le compartiment peut investir dans des instruments financiers dérivés à des fins d'exposition.

Le compartiment peut investir dans des instruments financiers dérivés à des fins de couverture. Le niveau d'engagement aux fins de couverture peut atteindre jusqu'à 100 % des actifs nets du compartiment. Le compartiment peut investir dans des instruments financiers dérivés à des fins de couverture de change. Le niveau d'engagement aux fins de couverture de change peut atteindre jusqu'à 100 % des actifs nets du compartiment.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt, les futures d'indices d'actions et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

L'utilisation d'instruments financiers dérivés sera limitée à 100 % de l'actif net du compartiment.

ABN AMRO Funds Candriam Total Return Global Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam Total Return Global Equities

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Candriam

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque opérationnel et risque de conservation
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risque de crédit
- Risque lié aux dérivés
- Risque de contrepartie

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1890809996 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1890810143 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neulize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU1890810226 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |

⁽¹⁾ Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,75% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie I | 0,75% | - | - | 0,18% | 0,01% |

⁽¹⁾ Par ailleurs, la Société peut être soumise au paiement d'un impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

⁽¹⁾ En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

ABN AMRO Funds Candriam Total Return Global Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Candriam Total Return Global Equities

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|---------------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 27 novembre 2020.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

sous son nom abrégé ABN AMRO EdenTree European Sustainable Equities

ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions européennes durables, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi. Le compartiment utilise une combinaison d'indicateurs financiers et extra-financiers pour identifier les titres qui répondent aux critères de durabilité globale appliqués par le Gestionnaire d'investissement externe. Le compartiment est composé d'émetteurs exposés à quatre thèmes durables à long terme tels que (i) « l'éducation », (ii) « la santé et le bien-être », (iii) « l'infrastructure sociale » et (iv) « les solutions durables ».

L'objectif d'investissement durable du compartiment est de s'aligner sur l'Accord de Paris, dans lequel les gouvernements mondiaux s'engagent à limiter la hausse de la température mondiale à 2 °C par rapport aux niveaux préindustriels. En outre, dans le cadre de son objectif d'investissement socialement durable, le compartiment investit dans des sociétés contribuant positivement aux solutions sociales.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières de, sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique en Europe. L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. Le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds conformes à l'article 9 du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers et qui ont été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Les investissements en titres de créance n'excéderont pas 15 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique de durabilité

Le compartiment contribue aux objectifs environnementaux et sociaux et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 9 du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers.

L'analyse ESG couvre 100 % du portefeuille. Après examen de l'univers d'investissement, 20 % des sociétés sont exclues en raison des critères ISR.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 9. De plus, des contrôles éthiques du Gestionnaire d'investissement externe sont également mis en œuvre. La combinaison des deux ensembles d'exclusions supprime, sur la base d'une « absence de préjudice », les domaines du marché qui causent des dommages sociaux ou environnementaux (p. ex. tabac, armes, jeux de hasard).

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut investir dans des instruments dérivés et autres instruments financiers tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral uniquement à des fins de gestion efficace de portefeuille.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

La méthode de calcul du Portefeuille de référence est disponible sur le site Internet suivant : www.msci.com.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composantes sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities sous son nom abrégé ABN AMRO EdenTree European Sustainable Equities

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

EdenTree Investment Management Limited.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque opérationnel et risque de conservation
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risque lié aux bons de souscription
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1481504865 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie R | CAP | LU1670606257 | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU1481504949 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie D | CAP | LU1670606174 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1481505086 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neufelize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU1670606331 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |
| | DIS | LU2474253577 | | Oui | | |
| Catégorie Z | CAP | LU1890795674 | Oui | Non | Investisseurs autorisés | 100 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,50% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie R | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie I | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |
| Catégorie Z | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) Par ailleurs, la Société peut être soumise au paiement d'un impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities sous son nom abrégé ABN AMRO EdenTree European Sustainable Equities

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie R | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |
| Catégorie Z | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée.

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Ce compartiment a été lancé le 19 janvier 2017.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities

sous son nom abrégé ABN AMRO Emerging Markets ESG Equities

ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions des marchés émergents, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi. Pour sélectionner les titres éligibles, le gestionnaire effectue une analyse financière et extra-financière selon des critères ESG (environnementaux, sociaux, de gouvernance) en association avec des filtres d'exclusion. Le portefeuille est composé d'émetteurs qui sont des leaders dans les bonnes pratiques ESG.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives ou les bons de souscription de valeurs mobilières émis par des sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique dans les marchés émergents.

L'allocation d'actifs minimum sur une base consolidée (investissements directs et indirects via l'utilisation d'instruments dérivés) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % de son actif net dans des actions chinoises (Actions A), libellées en CNH, qui sont cotées sur la Bourse de Hong Kong via le Shanghai-Hong Kong et Shenzhen Stock Connect.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment peut également investir dans des titres de créance (tels que des obligations à taux fixe et variable, des Instruments du marché monétaire, y compris des obligations à haut rendement) à concurrence de 10 % de ses actifs nets, notamment à des fins de gestion de trésorerie.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales ou sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 90 % du portefeuille. Le gestionnaire adopte une approche sélective qui filtre au moins 20 % de l'univers d'investissement.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le compartiment peut avoir recours à des positions non complexes sur instruments financiers dérivés ou utiliser des instruments financiers dérivés uniquement à des fins d'investissement, de couverture ou de gestion efficace de portefeuille.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Par ailleurs, le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Emerging Markets ESG Equities

Gestionnaire d'investissement

ABN AMRO Investment Solutions

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque opérationnel et risque de conservation
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risques spécifiques liés aux investissements en Chine
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU2445654507 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie G | CAP | LU2445654689 | Oui | Non | Investisseurs clients de la Gestion de portefeuille discrétionnaire des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et ayant conclu un accord de commissions spécifique et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie R | CAP | LU2445654762 | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU2445654846 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires et OPC | 1 000 000 EUR |

⁽¹⁾ Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 2,00% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégorie G | 2,00% | - | - | 0,25 % | 0,01% |
| Catégorie R | 1,10% | - | - | 0,25 % | 0,05 % |
| Catégorie I | 1,00% | - | - | 0,25 % | 0,01% |

⁽¹⁾ La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie G | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie R | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

⁽¹⁾ En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Emerging Markets ESG Equities

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'USD est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En EUR pour les catégories suivantes : « Catégorie A », « Catégorie G », « Catégorie R » et « Catégorie I ».

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|---------------------------------------|--|--|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Trois jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+3) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment sera lancé à une date non encore déterminée par le Conseil d'administration.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Global ESG Equities

sous son nom abrégé ABN AMRO Global ESG Equities

ABN AMRO Funds Global ESG Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions mondiales durables, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi. Pour sélectionner les titres éligibles, le gestionnaire effectue une analyse financière et extra-financière selon des critères ESG (environnementaux, sociaux, de gouvernance) en association avec des filtres d'exclusion. Le portefeuille est composé d'émetteurs qui sont des leaders dans les bonnes pratiques ESG.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières de, sociétés situées dans le monde entier.

L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des marchés émergents, y compris des actions chinoises (Actions A).

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Les investissements en titres de créance n'excèdent pas 10 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers.

L'analyse extra-financière couvre au moins 90 % du portefeuille. Le gestionnaire adopte une approche sélective qui filtre au moins 20 % de l'univers d'investissement.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le compartiment peut avoir recours à des positions non complexes sur instruments financiers dérivés ou utiliser des instruments financiers dérivés uniquement à des fins de couverture.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

La méthode de calcul du Portefeuille de référence est disponible sur le site Internet suivant : www.msci.com.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement

ABN AMRO Investment Solutions

ABN AMRO Funds Global ESG Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Global ESG Equities

Conseiller externe

ABN AMRO Bank N.V.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque opérationnel et risque de conservation
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risques liés aux investissements en Asie
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|------------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU0756526744 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU0756527049 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie CH EUR | CAP | LU0756527122 | Oui | Non | | 5 000 EUR |
| Catégorie D | CAP | LU1670611174 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie E | CAP | LU1029691976 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de ABN AMRO et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1329507765 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neulize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie G | CAP | LU2445654929 | Oui | Non | Investisseurs clients de la Gestion de portefeuille discrétionnaire des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et ayant conclu un accord de commissions spécifique et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU0851647916 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |

⁽¹⁾ Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|----------------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,50% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégories C, CH EUR | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,50% | - | - | 0,18 % | 0,05 % |
| Catégorie E | 0,50% | - | - | 0,18 % | 0,05 % |
| Catégorie F | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie G | 1,50% | - | - | 0,18 % | 0,01 % |
| Catégorie I | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |

⁽¹⁾ La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

ABN AMRO Funds Global ESG Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Global ESG Equities

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|----------------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégories C, CH EUR | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie E | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie G | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Ce compartiment a été lancé le 25 mars 2013.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

sous son nom abrégé ABN AMRO Impax US ESG Equities

ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions américaines durables, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi. La stratégie du compartiment consiste à investir dans des sociétés dotées d'avantages concurrentiels durables qui sont positionnées pour atteindre des rendements élevés ou en amélioration sur l'horizon d'investissement. Le compartiment utilise une combinaison d'indicateurs financiers et extra-financiers pour identifier les titres qui répondent aux critères de durabilité globale appliqués par le Gestionnaire d'investissement externe.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières, des sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique aux États-Unis d'Amérique.

L'allocation d'actifs minimum sur une base consolidée (investissements directs et indirects via l'utilisation d'instruments dérivés) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % en ADR/GDR.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des OPCVM éligibles sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les OPCVM éligibles ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment peut également investir dans des titres de créance (tels que des obligations à taux fixe et variable, des Instruments du marché monétaire, y compris des obligations à haut rendement) à concurrence de 10 % de ses actifs nets, notamment à des fins de gestion de trésorerie.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

Par conséquent, le portefeuille affiche un score ESG supérieur par rapport à son indice de référence. Chaque action du portefeuille du compartiment fait l'objet d'une analyse ESG. Au moins 20 % des sociétés de l'univers d'investissement initial ne sont pas éligibles à l'inclusion dans le portefeuille.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures d'indices d'action et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Impax US ESG Equities

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Impax Asset Management, LLC

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque lié aux bons de souscription
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|------------------|--|----------------|--------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU2546367207 « Catégorie A-EUR » LU2546367116 « Catégorie A-USD » | Oui | Non | Tous | 100 EUR 100 USD |
| | DIS | LU2546367033 « Catégorie A-GBP » | | Oui | | 100 GBP |
| | Catégorie AH EUR | CAP | | LU2546366902 | | Non |
| Catégorie R | CAP | LU2546366811 « Catégorie R-EUR » LU2546366738 « Catégorie R-USD » | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR 100 USD |
| | DIS | LU2546366571 « Catégorie R-GBP » | | Oui | | 100 GBP |
| | Catégorie RH EUR | CAP | | LU2546366498 | | Non |
| Catégorie C | CAP | LU2546366225 « Catégorie C-EUR » | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU2546366142 « Catégorie I-EUR » LU2546366068 « Catégorie I-USD » | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR 1 000 000 USD |
| | DIS | LU2546368197 « Catégorie I-GBP » | | Oui | | 1 000 000 GBP |
| | Catégorie IH EUR | CAP | | LU2546368270 | | Non |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Impax US ESG Equities

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|----------------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégories A, AH EUR | 1,50% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégories R, RH EUR | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégories I, IH EUR | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|----------------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégories A, AH EUR | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégories R, RH EUR | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégories I, IH EUR | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'USD est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En USD pour les catégories suivantes : « Catégorie A-USD », « Catégorie R-USD » et « Catégorie I-USD ».

En EUR pour les catégories suivantes : « Catégorie A-EUR », « Catégorie AH-EUR », « Catégorie R-EUR », « Catégorie RH-EUR », « Catégorie C », « Catégorie I-EUR » et « Catégorie IH-EUR ».

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 13 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 14 décembre 2022.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Insight Euro Aggregate Bonds

sous son nom abrégé ABN AMRO Insight Euro Aggregate Bonds

ABN AMRO Funds Insight Euro Aggregate Bonds

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'obligations consolidées libellées en euro, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

La stratégie du compartiment se base sur une approche équilibrée de gestion des risques en investissant principalement dans des obligations d'entreprises de qualité investment grade libellées en euro émises par des sociétés situées dans des pays de la zone euro et dans des obligations de qualité investment grade et des titres considérés comme des produits équivalents aux obligations tels que des obligations à revenu fixe et à taux variable, libellés en euro émis ou garantis par des États membres de l'Union européenne appartenant à la zone euro.

Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le compartiment peut également, de manière limitée, avoir recours à une variété (i) d'instruments dont, entre autres, des contrats à terme de taux, des contrats de change à terme (incluant les contrats de change à terme non livrables), des futures de taux d'intérêt, des futures d'obligations et des swaps négociés de gré à gré tels que des swaps de taux d'intérêt et des swaps de défaut de crédit, et (ii) de stratégies axées, notamment, sur l'anticipation des fluctuations de taux, le positionnement sur la courbe de rendements, la sélection des émetteurs, la valeur relative et les devises.

L'allocation d'actifs minimum sur une base consolidée (investissements directs et indirects via l'utilisation d'instruments dérivés) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment.

Les restrictions suivantes s'appliquent au compartiment :

| | |
|--|--|
| - Exposition maximale aux titres à revenu fixe d'émetteurs européens situés en dehors de la zone euro : | 20% |
| - Exposition maximale aux titres à revenu fixe d'émetteurs non européens situés dans des pays développés : | 20% |
| - Exposition maximale aux obligations convertibles : | 20% |
| - Exposition maximale aux titres à haut rendement et aux marchés émergents : | 30% |
| - Exposition maximale aux Instruments du marché monétaire : | 30% |
| - Exposition maximale aux titres non notés : | 10% |
| - Exposition maximale aux titres adossés à des actifs (ABS)/titres adossés à des crédits hypothécaires (MBS) : | 20% |
| - Duration : | +/- 2 ans (comparé au Portefeuille de référence) |
| - Exposition maximale au risque de change : | 10% |
| - Allocation maximale aux actions : | 10% |

L'allocation aux actions sera le résultat de la conversion des obligations convertibles en actions. Le gestionnaire n'est pas autorisé à acheter activement des titres de capital.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs, mais peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des Actifs « distressed » (en difficulté).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

En vertu des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance de ManCo et conformément aux Principes pour l'investissement responsable des Nations Unies, le compartiment exclut tout investissement direct dans des titres émis par des sociétés impliquées dans des activités hautement controversées (telles que la production de tabac et d'armes controversées) et/ou en violation grave des principes du Pacte mondial des Nations Unies.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) à des fins d'investissement, de couverture et de gestion efficace de portefeuille ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

ABN AMRO Funds Insight Euro Aggregate Bonds sous son nom abrégé ABN AMRO Insight Euro Aggregate Bonds

Le niveau d'engagement généré par les instruments financiers dérivés est limité à 100 % de l'actif net du compartiment. Par conséquent, l'exposition du compartiment variera de 0 à 100 %.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Insight Investment Management (Global) Limited.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de crédit
- Risque lié aux dérivés
- Risque de contrepartie
- Risques liés aux obligations à haut rendement
- Risque de liquidité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU2054453407 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| | DIS | LU2257990676 | | | | |
| Catégorie C | CAP | LU2054453589 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie D | CAP | LU2054453662 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU2054453746 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neulize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 0,70% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

ABN AMRO Funds Insight Euro Aggregate Bonds sous son nom abrégé ABN AMRO Insight Euro Aggregate Bonds

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 9 juillet 2020.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds

sous son nom abrégé ABN AMRO Insight Euro ESG Corporate Bonds

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'obligations d'entreprises durables libellées en euro, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi. Le compartiment utilise une sélection de titres respectant les critères de responsabilité environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG). Le portefeuille est composé d'émetteurs qui sont soit des leaders dans les bonnes pratiques ESG, soit attractifs en raison de leur progression sur les questions ESG.

Politique d'investissement

Le compartiment est activement géré selon une approche descendante et ascendante tout en tenant compte des facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG). Le portefeuille de résultats combine trois principaux moteurs de performance : la notation de crédit, l'allocation sectorielle et la sélection des titres sur le marché des entreprises. Toutefois, la durée, la courbe de rendement et la devise fournissent des sources de rendement supplémentaires pour la stratégie.

Le compartiment investit principalement dans des obligations d'entreprises de qualité investment grade et autres titres à taux fixe ou variable libellés en euro et sans contraintes en matière de notation. Afin d'atteindre son objectif, le compartiment peut également avoir recours à une variété d'instruments, dont, entre autres, des contrats à terme de taux, des contrats de change à terme (incluant les contrats de change à terme non livrables), des futures de taux d'intérêt, des futures d'obligations et des swaps négociés de gré à gré tels que des swaps de taux d'intérêt, des swaps de défaut de crédit et des stratégies (par exemple, des stratégies axées sur la courbe de rendement et l'arbitrage par le biais d'investissements dans les titres et les instruments dérivés indiqués ci-dessus).

L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment sera tenu, pour les 40 % du total de ses actifs nets restants et sur une base consolidée, de respecter toutes les limitations établies au regard des investissements en titres/instruments mentionnés ci-dessous :

- (i) 25 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des obligations convertibles et autres titres de créance liés à des actions ;
- (ii) un tiers maximum du total des actifs nets du compartiment peut être investi dans des instruments du marché monétaire, dont, entre autres, des certificats de dépôt, des dépôts à court terme et des dépôts bancaires à vue ;
- (iii) 10 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des valeurs mobilières ;
- (iv) 10 % maximum de ses actifs nets peuvent être investis dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers.

100 % des obligations en portefeuille font l'objet d'une analyse extra-financière. Les seules participations qui ne sont pas directement soumises à une analyse extra-financière sont les liquidités et les fonds de trésorerie.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Ils sont principalement utilisés à des fins de couverture et l'investissement dans des produits dérivés n'est pas l'objectif principal du compartiment, c'est pourquoi il ne cherche pas à atteindre un objectif de durabilité ou à obtenir une analyse ESG.

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds sous son nom abrégé ABN AMRO Insight Euro ESG Corporate Bonds

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

La méthode de calcul du Portefeuille de référence est disponible sur le site Internet suivant : www.markit.com.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Insight Investment Management (Global) Limited.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1165274488 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU1165274645 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie D | CAP | LU1718321521 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1329508904 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neulize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |

⁽¹⁾ Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 0,70% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,01% |

⁽¹⁾ La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds
sous son nom abrégé ABN AMRO Insight Euro ESG Corporate Bonds

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 1^{er} avril 2015 pour les catégories suivantes : « Catégorie A » et « Catégorie C ».

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

sous son nom abrégé ABN AMRO JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'obligations d'entreprises durables libellées en euro, sans restriction spécifique à l'écart de suivi et chercher à minimiser l'impact de la hausse des taux d'intérêt sur les rendements.

Le compartiment utilise une sélection de titres respectant les critères de responsabilité environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG). Le portefeuille est composé d'émetteurs qui sont soit des leaders dans les bonnes pratiques ESG, soit attractifs en raison de leur progression sur les questions ESG.

Politique d'investissement

Le compartiment est activement géré selon une approche descendante et ascendante tout en tenant compte des facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG). Le portefeuille de résultats combine trois principaux moteurs de performance : la notation de crédit, l'allocation sectorielle et la sélection des titres sur le marché des entreprises. Toutefois, la durée, la courbe de rendement et la devise fournissent des sources de rendement supplémentaires pour la stratégie.

Le compartiment investit principalement dans des obligations d'entreprises de qualité investment grade et autres titres à taux fixe ou variable libellés en euro et sans contraintes en matière de notation. Afin d'atteindre son objectif, le compartiment peut également avoir recours à une variété d'instruments, dont, entre autres, des contrats à terme de taux, des contrats de change à terme (incluant les contrats de change à terme non livrables), des futures de taux d'intérêt, des futures d'obligations et des swaps négociés de gré à gré tels que des swaps de taux d'intérêt, des swaps de défaut de crédit et des stratégies (par exemple, des stratégies axées sur la courbe de rendement et l'arbitrage par le biais d'investissements dans les titres et les instruments dérivés indiqués ci-dessus).

L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment sera tenu, pour les 40 % du total de ses actifs nets restants et sur une base consolidée, de respecter toutes les limitations établies au regard des investissements en titres/instruments mentionnés ci-dessous :

- (i) 25 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des obligations convertibles et autres titres de créance liés à des actions ;
- (ii) un tiers maximum du total des actifs nets du compartiment peut être investi dans des instruments du marché monétaire, dont, entre autres, des certificats de dépôt, des dépôts à court terme et des dépôts bancaires à vue ;
- (iii) 10 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des valeurs mobilières ;
- (iv) 10 % maximum de ses actifs nets peuvent être investis dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Ce compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers.

100 % des obligations en portefeuille font l'objet d'une analyse extra-financière. Les seules participations qui ne sont pas directement soumises à une analyse extra-financière sont les liquidités et les fonds de trésorerie.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment cherchera à réduire la durée dans une mesure équivalente à la durée de son Portefeuille de référence par le biais de dérivés cotés. Le portefeuille peut rester exposé à un certain risque de durée correspondant à la prise de risque active du gestionnaire.

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities **sous son nom abrégé ABN AMRO JPMorgan Asia Pacific ESG Equities**

Ils sont principalement utilisés à des fins de couverture et l'investissement dans des produits dérivés n'est pas l'objectif principal du compartiment, c'est pourquoi il ne cherche pas à atteindre un objectif de durabilité ou à obtenir une analyse ESG.

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

La méthode de calcul du Portefeuille de référence est disponible sur le site Internet suivant : www.theice.com.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Insight Investment Management (Global) Limited.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale⁽¹⁾ |
|------------------|-----------------------|------------------|-----------------------|-------------------|---|---|
| Catégorie A | CAP | LU1253565839 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU1253565912 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie D | CAP | LU1733876954 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1733877093 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neulize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 0,70% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Les « Catégorie A » et « Catégorie C » ont été lancées le 9 mars 2018 à la suite de leur fusion avec tous les actifs et passifs des « Catégorie AH DUR » et « Catégorie CH DUR » respectivement du compartiment « ABN AMRO Funds Insight Euro Corporate Bonds » de la Société.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

sous son nom abrégé ABN AMRO JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions des marchés de la région Pacifique, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi. Le compartiment utilise une sélection de titres respectant les critères de responsabilité environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG). Le portefeuille est composé d'émetteurs qui sont soit des leaders dans les bonnes pratiques ESG, soit attractifs en raison de leur progression sur les questions ESG.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives ou les bons de souscription de valeurs mobilières émises par des sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique dans la région Pacifique.

L'allocation d'actifs minimum sur une base consolidée (investissements directs et indirects via l'utilisation d'instruments dérivés) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment peut également investir dans des titres de créance (tels que des obligations à taux fixe et variable, des Instruments du marché monétaire, y compris des obligations à haut rendement) à concurrence de 10 % de ses actifs nets, notamment à des fins de gestion de trésorerie. Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 90 % du portefeuille.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % du total de ses actifs nets dans des Fonds passifs externes et/ou des ETF qui relèvent de l'article 6 du règlement SFDR. Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures d'indices d'action et les futures de change) à des fins d'investissement, de couverture et de gestion efficace de portefeuille ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities sous son nom abrégé ABN AMRO JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

JPMorgan Asset Management (Europe).

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque opérationnel et risque de conservation
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risque lié aux bons de souscription
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU2757517748 « Catégorie A-EUR » LU2757517664 « Catégorie A-USD » | Oui | Non | Tous | 100 EUR 100 USD |
| | DIS | LU2757517581 | | Oui | | 100 GBP |
| Catégorie R | CAP | LU2757517409 « Catégorie R-EUR » LU2757517318 « Catégorie R-USD » | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR 100 USD |
| | DIS | LU2757517235 | | Oui | | 100 GBP |
| Catégorie C | CAP | LU2757517151 « Catégorie C-EUR » LU2757517078 « Catégorie C-USD » | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR 5 000 USD |
| Catégorie I | CAP | LU2757516930 « Catégorie I-EUR » LU2757516856 « Catégorie I-USD » | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR 1 000 000 USD |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,50 % | - | - | 0,20 % | 0,05 % |
| Catégorie R | 0,85 % | - | - | 0,20 % | 0,05 % |
| Catégorie C | 0,85 % | - | - | 0,20 % | 0,05 % |
| Catégorie I | 0,75 % | - | - | 0,20 % | 0,01 % |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00 % | 1,00 % | 1,00 % |
| Catégorie R | 5,00 % | 1,00 % | 1,00 % |
| Catégorie C | 5,00 % | 1,00 % | 1,00 % |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'USD est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En USD pour les catégories suivantes : « Catégorie A-USD », « Catégorie R-USD », « Catégorie C-USD » et « Catégorie I-USD ».

En EUR pour les catégories suivantes : « Catégorie A-EUR », « Catégorie R-EUR », « Catégorie C-EUR » et « Catégorie I-EUR ».

En GBP pour les catégories suivantes : « Catégorie A-GBP » et « Catégorie R-GBP ».

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|--|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Trois jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+3) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment sera lancé à une date non encore déterminée par le Conseil d'administration.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux investisseurs potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leurs investissements.

ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds

sous son nom abrégé ABN AMRO Kempen Euro Corporate Bonds

ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'obligations d'entreprises libellées en euro, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des obligations d'entreprises de qualité investment grade et autres titres à taux fixe ou variable libellés en euro et sans contraintes en matière de notation. Afin d'atteindre son objectif, le compartiment peut également avoir recours à une variété d'instruments, dont, entre autres, des contrats à terme de taux, des contrats de change à terme (incluant les contrats de change à terme non livrables), des futures de taux d'intérêt, des futures d'obligations et des swaps négociés de gré à gré tels que des swaps de taux d'intérêt, des swaps de défaut de crédit et des stratégies (par exemple, des stratégies axées sur la courbe de rendement et l'arbitrage par le biais d'investissements dans les titres et les instruments dérivés indiqués ci-dessus).

L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment sera tenu, pour les 40 % du total de ses actifs nets restants et sur une base consolidée, de respecter toutes les limitations établies au regard des investissements en titres/instruments mentionnés ci-dessous :

- (i) 25 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des obligations convertibles (hors obligations convertibles conditionnelles), d'autres titres de créance liés à des actions et des titres de créance à haut rendement ;
- (ii) un tiers maximum du total des actifs nets du compartiment peut être investi dans des instruments du marché monétaire, dont, entre autres, des certificats de dépôt, des dépôts à court terme et des dépôts bancaires à vue ;
- (iii) 10 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des valeurs mobilières ;
- (iv) 10 % maximum de ses actifs nets peuvent être investis dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 90 % du portefeuille.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % du total de ses actifs nets dans des Fonds passifs externes et/ou des ETF qui relèvent de l'article 6 du règlement SFDR. Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds sous son nom abrégé ABN AMRO Kempen Euro Corporate Bonds

Gestionnaire d'investissement externe

Kempen Capital Management N.V.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risques liés aux obligations à haut rendement
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1253565086 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU1253565243 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| | DIS | LU2631872293 | Oui | Oui | | |
| Catégorie D | CAP | LU1670610952 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1329511874 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neufelize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 0,70% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds
sous son nom abrégé ABN AMRO Kempen Euro Corporate Bonds

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 6 octobre 2015.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged sous son nom abrégé ABN AMRO Kempen Euro Corporate Bonds DH

ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'obligations d'entreprises libellées en euro, sans restriction spécifique à l'écart de suivi et chercher à minimiser l'impact de la hausse des taux d'intérêt sur les rendements.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des obligations d'entreprises de qualité investment grade et autres titres à taux fixe ou variable libellés en euro et sans contraintes en matière de notation. Afin d'atteindre son objectif, le compartiment peut également avoir recours à une variété d'instruments, dont, entre autres, des contrats à terme de taux, des contrats de change à terme (incluant les contrats de change à terme non livrables), des futures de taux d'intérêt, des futures d'obligations et des swaps négociés de gré à gré tels que des swaps de taux d'intérêt, des swaps de défaut de crédit et des stratégies (par exemple, des stratégies axées sur la courbe de rendement et l'arbitrage par le biais d'investissements dans les titres et les instruments dérivés indiqués ci-dessus).

L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment sera tenu, pour les 40 % du total de ses actifs nets restants et sur une base consolidée, de respecter toutes les limitations établies au regard des investissements en titres/instruments mentionnés ci-dessous :

- (i) 25 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des obligations convertibles (hors obligations convertibles conditionnelles), d'autres titres de créance liés à des actions et des titres de créance à haut rendement ;
- (ii) un tiers maximum du total des actifs nets du compartiment peut être investi dans des instruments du marché monétaire, dont, entre autres, des certificats de dépôt, des dépôts à court terme et des dépôts bancaires à vue ;
- (iii) 10 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des valeurs mobilières ;
- (iv) 10 % maximum de ses actifs nets peuvent être investis dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Le compartiment cherchera à réduire la duration dans une mesure équivalente à la duration de son Portefeuille de référence par le biais de dérivés cotés. Le portefeuille peut rester exposé à un certain risque de duration correspondant à la prise de risque active du gestionnaire.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 90 % du portefeuille.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % du total de ses actifs nets dans des Fonds passifs externes et/ou des ETF qui relèvent de l'article 6 du règlement SFDR. Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged sous son nom abrégé ABN AMRO Kempen Euro Corporate Bonds DH

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Kempen Capital Management N.V.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risques liés aux obligations à haut rendement
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1253565169 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU1253565326 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie D | CAP | LU1733877176 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1733877259 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neuflyze OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 0,70% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged sous son nom abrégé ABN AMRO Kempen Euro Corporate Bonds DH

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Les « Catégorie A » et « Catégorie C » ont été lancées le 9 mars 2018 à la suite de leur fusion avec tous les actifs et passifs des « Catégorie AH DUR » et « Catégorie CH DUR » respectivement du compartiment « ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds » de la Société.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities **sous son nom abrégé ABN AMRO Liontrust European Sustainable Equities**

ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions européennes durables, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi. Le compartiment utilise une combinaison d'indicateurs financiers et extra-financiers pour identifier les titres qui répondent aux critères de durabilité globale appliqués par le Gestionnaire d'investissement externe. Le compartiment sera composé d'émetteurs qui sont positivement exposés à trois thèmes durables à long terme tels que (i) « efficacité des ressources améliorée », (ii) « meilleure santé » et (iii) « sécurité et résilience accrues », tout en offrant une appréciation du capital à long terme. L'objectif d'investissement durable et environnemental du compartiment est d'investir dans des sociétés qui soutiennent l'objectif de zéro émission nette de gaz à effet de serre d'ici 2050, conformément à l'engagement de l'initiative Net-Zero Asset Managers (NZAMI) du gestionnaire d'investissement externe et aux objectifs de l'Accord de Paris. En outre, dans le cadre de son objectif d'investissement socialement durable, le compartiment investit dans des sociétés contribuant positivement aux solutions sociales.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières de, sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique en Europe.

Le compartiment est géré activement selon un processus ascendant/de sélection de titres. L'équipe a pour objectif d'identifier les thèmes durables à long terme qui seront le moteur de la croissance des sociétés. Selon le gestionnaire d'investissement, ces sociétés seront dotées d'un fort potentiel de croissance en raison de leur alignement sur ces thèmes, de leur excellente gestion et de leurs solides fondamentaux commerciaux. Il en résulte un portefeuille composé de 40 à 60 titres de qualité évalués de manière raisonnable (cette fourchette pouvant toutefois varier en fonction des conditions de marché).

L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. Le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds conformes à l'article 9 du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers et qui ont été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Les investissements en titres de créance n'excéderont pas 15 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment contribue aux objectifs environnementaux et sociaux et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 9 du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers.

Le processus extra-financier couvre 100 % du portefeuille (la trésorerie et les instruments dérivés ne sont pas couverts par l'analyse ESG). L'univers d'investissement est réduit d'au moins 20 % après la mise en œuvre des filtres de durabilité.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 9. Le Gestionnaire d'investissement externe peut également mettre en œuvre d'autres exclusions. À cet égard, le gestionnaire de portefeuille externe n'investit pas dans des sociétés qui ont une implication stratégique dans le nucléaire.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Liontrust European Sustainable Equities

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Liontrust Investment Partners LLP

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque opérationnel et risque de conservation
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risque lié aux bons de souscription
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU0849850747 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie R | CAP | LU1890795757 | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU0849850820 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie D | CAP | LU1718323147 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1329512096 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neufelize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU0849851042 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |
| | DIS | LU2474253650 | | Oui | | |
| Catégorie Z | CAP | LU1890796052 | Oui | Non | Investisseurs autorisés | 100 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Liontrust European Sustainable Equities

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,50% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie R | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie I | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |
| Catégorie Z | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie R | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |
| Catégorie Z | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 23 avril 2018.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

sous son nom abrégé ABN AMRO Liontrust Global Impact Equities

ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions dont les sociétés génèrent des avantages socioéconomiques ou environnementaux mesurables, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi. Le compartiment utilise une combinaison d'indicateurs financiers et extra-financiers pour identifier les titres qui répondent aux critères de durabilité globale appliqués par le Gestionnaire d'investissement externe. Les critères de durabilité sont conçus pour identifier les entreprises ayant un impact environnemental et social positif et conformes aux Objectifs de développement durable de l'ONU, tout en offrant une appréciation du capital à long terme.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières de, sociétés situées dans le monde entier.

Le compartiment est géré selon un processus ascendant/de sélection de titres. L'équipe a pour objectif d'identifier les thèmes d'impact durable à long terme qui seront le moteur de la croissance des sociétés dans la réalisation des Objectifs de développement durable (ODD) de l'ONU. Il en résulte un portefeuille composé de 30 à 35 titres de qualité évalués de manière raisonnable (cette fourchette pouvant toutefois varier en fonction des conditions de marché).

L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds conformes à l'article 9 du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers et qui ont été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment peut également investir dans des titres de créance (tels que des obligations à taux fixe et variable, des Instruments du marché monétaire, y compris des obligations à haut rendement) à concurrence de 10 % de ses actifs nets, notamment à des fins de gestion de trésorerie.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment contribue aux objectifs environnementaux et sociaux et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 9 du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers.

Le processus extra-financier couvre 100 % des titres en portefeuille (la trésorerie et les instruments dérivés ne sont pas couverts par l'analyse ESG). L'univers d'investissement est réduit d'au moins 20 % après la mise en œuvre des filtres de durabilité.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 9. Le Gestionnaire d'investissement externe peut également mettre en œuvre d'autres exclusions. À cet égard, le gestionnaire de portefeuille externe n'investit pas dans des sociétés qui ont une implication stratégique dans le nucléaire.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Liontrust Global Impact Equities

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Liontrust Investment Partners LLP

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque opérationnel et risque de conservation
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risque lié aux bons de souscription
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU2281293485 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie R | CAP | LU2281293568 | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU2281293725 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie D | CAP | LU2281293998 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU2281294020 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neufelize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU2281294293 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |
| | DIS | LU2474253734 | | Oui | | |
| Catégorie Z | CAP | LU2281294459 | Oui | Non | Investisseurs autorisés | 100 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Liontrust Global Impact Equities

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,50% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie R | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie I | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |
| Catégorie Z | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie R | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |
| Catégorie Z | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 13 avril 2021.

Néant.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities **sous son nom abrégé ABN AMRO M&G Emerging Markets Equities**

ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions des marchés émergents, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré activement selon un processus ascendant/de sélection de titres associant la sélection quantitative (afin de réduire l'univers) à la recherche fondamentale. Le compartiment vise à identifier les sociétés sous-évaluées dotées, selon le gestionnaire d'investissement, d'un potentiel de création de valeur à long terme. Il en résulte un portefeuille diversifié composé de sociétés de moyenne et grande capitalisations (50 à 70 titres, cette fourchette pouvant varier en fonction des conditions de marché), qui reflète les plus fortes convictions de l'équipe.

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives ou les bons de souscription de valeurs mobilières émises par des sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique dans les marchés émergents.

L'allocation d'actifs minimum sur une base consolidée (investissements directs et indirects via l'utilisation d'instruments dérivés) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Les investissements en titres de créance n'excéderont pas 15 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % de son actif net dans des actions chinoises (Actions A), libellées en CNH, qui sont cotées sur la Bourse de Hong Kong via le Shanghai-Hong Kong et Shenzhen Stock Connect.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 75 % du portefeuille.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % du total de ses actifs nets dans des Fonds passifs externes et/ou des ETF qui relèvent de l'article 6 du règlement SFDR. Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut investir dans des instruments financiers dérivés à des fins d'exposition et de couverture.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

M&G Investment Management Limited

ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities sous son nom abrégé ABN AMRO M&G Emerging Markets Equities

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque opérationnel et risque de conservation
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risque lié aux bons de souscription
- Risques spécifiques liés aux investissements en Chine
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1577878611 « Catégorie A-EUR » | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU1577878884 « Catégorie C-EUR » LU1577878967 « Catégorie C-USD » | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR 5 000 USD |
| Catégorie D | CAP | LU1670612065 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1577879007 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neulize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU1577879189 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 USD |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 2,00% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégorie C | 1,10% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégorie D | 1,10% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégorie F | 1,10% | - | - | 0,25 % | 0,01% |
| Catégorie I | 1,00% | - | - | 0,20% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO M&G Emerging Markets Equities

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'USD est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En USD pour les catégories suivantes : « Catégorie C-USD » et « Catégorie I ».

En EUR pour les catégories suivantes : « Catégorie A-EUR », « Catégorie C-EUR », « Catégorie D » et « Catégorie F ».

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|--|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Trois jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+3) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Ce compartiment a été lancé le 21 novembre 2017.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Numeric Emerging Markets Equities

sous son nom abrégé ABN AMRO Numeric Emerging Markets Equities

ABN AMRO Funds Numeric Emerging Markets Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions des marchés émergents, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré selon un processus d'investissement systématique et purement quantitatif. Ce processus fait appel à environ 20 indicateurs de marché sur la valorisation (entre autres : résultats, momentum des actions, momentum de style et qualité) et sur le flux d'information, pour évaluer les sociétés de l'univers au sein de groupes de pairs. Le portefeuille très diversifié (150 avoirs minimum, ce chiffre pouvant toutefois varier en fonction des conditions de marché) est ensuite construit à l'aide d'un modèle de risque exclusif conçu pour optimiser le rendement, tout en restant neutre aux facteurs de risque par rapport au Portefeuille de référence.

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives ou les bons de souscription de valeurs mobilières émises par des sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique dans les marchés émergents.

L'allocation d'actifs minimum sur une base consolidée (investissements directs et indirects via l'utilisation d'instruments dérivés) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Les investissements en titres de créance n'excéderont pas 15 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % de son actif net dans des actions chinoises (Actions A), libellées en CNH, qui sont cotées sur la Bourse de Hong Kong via le Shanghai-Hong Kong et Shenzhen Stock Connect.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

En vertu des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance de ManCo et conformément aux Principes pour l'investissement responsable des Nations Unies, le compartiment exclut tout investissement direct dans des titres émis par des sociétés impliquées dans des activités hautement controversées (telles que la production de tabac et d'armes controversées) et/ou en violation grave des principes du Pacte mondial des Nations Unies.

Instruments dérivés

Le compartiment peut investir dans des instruments financiers dérivés à des fins d'exposition et de couverture.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures d'indices d'action et les futures de change) à des fins d'investissement, de couverture et de gestion efficace de portefeuille ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Numeric Investors LLC.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque opérationnel et risque de conservation

ABN AMRO Funds Numeric Emerging Markets Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Numeric Emerging Markets Equities

- Risque lié aux marchés émergents
- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risque lié aux bons de souscription
- Risques spécifiques liés aux investissements en Chine.

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1165277820 « Catégorie A-EUR » LU1165278125 « Catégorie A-USD » | Oui | Non | Tous | 100 EUR 100 USD |
| Catégorie C | CAP | LU1165278638 « Catégorie C-EUR » LU1165278802 « Catégorie C-USD » | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR 5 000 USD |
| Catégorie D | CAP | LU1406019189 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1329509621 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neulize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU1181319671 « Catégorie I-EUR » LU1181318780 « Catégorie I-USD » | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR 1 000 000 USD |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 2,00% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégorie C | 1,10% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégorie D | 1,10% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégorie F | 1,10% | - | - | 0,25 % | 0,01% |
| Catégorie I | 1,00% | - | - | 0,20% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

ABN AMRO Funds Numeric Emerging Markets Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Numeric Emerging Markets Equities

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'USD est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En USD pour les catégories suivantes : « Catégorie A-USD », « Catégorie C-USD » et « Catégorie I-USD ».

En EUR pour les catégories suivantes : « Catégorie A-EUR », « Catégorie D », « Catégorie F », « Catégorie C-EUR » et « Catégorie I-EUR ».

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|--|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Trois jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+3) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Ce compartiment a été lancé le 1^{er} avril 2015.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux investisseurs potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leurs investissements.

ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

sous son nom abrégé ABN AMRO Parnassus US ESG Equities

ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions américaines durables, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi. Le portefeuille est composé de sociétés qui sont flexibles dans les bonnes pratiques ESG. Les Fonds cherchent à investir dans des sociétés qui ont une performance positive sur des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières tels que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières, de sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique en Amérique du Nord.

Le compartiment est géré activement selon une approche durable de sélection de titres/ascendante, conçue pour identifier les sociétés considérablement sous-évaluées selon le gestionnaire d'investissement, avec une équipe de direction efficace et un avantage concurrentiel important qui montre sa pertinence à long terme. Toutes les sociétés doivent respecter les critères de durabilité mis en place par le Gestionnaire de portefeuille et la Société de gestion.

Le portefeuille final est plutôt ciblé (généralement entre 35 et 45 avoirs, cette fourchette pouvant toutefois varier en fonction des conditions de marché) et construit selon des directives de diversification prédéterminées.

L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Les investissements en titres de créance n'excéderont pas 15 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers.

L'analyse de durabilité couvre 100 % des titres en portefeuille (la trésorerie et les dépôts ne sont pas couverts par l'analyse ESG).

Une fois les filtres de durabilité (exclusions et notation ESG) mis en œuvre, les sociétés du quartile inférieur sont exclues de l'univers d'investissement. Ainsi, le score ESG du portefeuille est supérieur à celui de l'univers d'investissement.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des instruments dérivés et autres instruments financiers tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral à des fins d'investissement, de gestion efficace de portefeuille ou de couverture.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

La méthode de calcul du Portefeuille de référence est disponible sur le site Internet suivant : www.msci.com.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

| |
|--|
| <p style="text-align: center;">ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Parnassus US ESG Equities</p> |
|--|

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Parnassus Investments

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque lié aux bons de souscription
- Risque lié aux dérivés
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Parnassus US ESG Equities

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|------------------|------------------|---|----------------|--------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1481505755 « Catégorie A-EUR » LU1481505672 « Catégorie A-USD » | Oui | Non | Tous | 100 EUR 100 USD |
| | DIS | LU1890797290 « Catégorie A-GBP » | | Oui | | 100 GBP |
| Catégorie AH EUR | CAP | LU1890796136 | | Non | | 100 EUR |
| Catégorie R | CAP | LU1670606760 « Catégorie R-EUR » LU1670606927 « Catégorie R-USD » LU2434831587 « Catégorie R-GBP » | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR 100 USD 100 GBP |
| | DIS | LU1670606844 « Catégorie R-GBP » LU2474253148 « Catégorie R-USD » | | Oui | | 100 GBP 100 USD |
| | Catégorie RH EUR | CAP | | LU1890796300 | | Non |
| Catégorie C | CAP | LU1481505839 « Catégorie C-EUR » LU2011271140 « Catégorie C-USD » | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR 5 000 USD |
| Catégorie D | CAP | LU1586378710 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1481505912 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neuflyze OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU1890796482 « Catégorie I-EUR » LU1481506050 « Catégorie I-USD » | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR 1 000 000 USD |

ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Parnassus US ESG Equities

| | | | | | | |
|---------------------|-----|--|-----|-----|-------------------------|----------------------------------|
| | DIS | LU1890796565 « Catégorie I- GBP » | | Oui | | 1 000 000 GBP |
| Catégorie IH EUR | CAP | LU1890797027 | | | | 1 000 000 EUR |
| Catégorie X1 | CAP | LU1955039661 « Catégorie X1- EUR » LU1955039745 « Catégorie X1- USD » | Oui | Non | Investisseurs autorisés | 50 000 000 EUR 50 000 000 USD |
| | DIS | LU1955039828 « Catégorie X1- GBP » | | Oui | | 50 000 000 GBP |
| Catégorie X1H | CAP | LU2387327351 « Catégorie X1H- EUR » | Oui | Non | Investisseurs autorisés | 50 000 000 EUR |
| Catégorie Z | CAP | LU1670607065 | Oui | Non | Investisseurs autorisés | 100 000 000 USD |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement⁽¹⁾ |
|-------------------------|------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------------|--|
| Catégories A, AH EUR | 1,50% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégories R, RH EUR | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégories I, IH EUR | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |
| Catégorie X1, X1H | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |
| Catégorie Z | 0,00% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) Par ailleurs, la Société peut être soumise au paiement d'un impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Parnassus US ESG Equities

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|----------------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégories A, AH EUR | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégories R, RH EUR | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégories I, IH EUR | - | - | - |
| Catégorie X1, X1H | - | - | - |
| Catégorie Z | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'USD est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En USD pour les catégories suivantes : « Catégorie A-USD », « Catégorie C-USD », « Catégorie R-USD », « Catégorie C-EUR », « Catégorie I-USD », « Catégorie X1-USD » et « Catégorie Z ».

En EUR pour les catégories suivantes : « Catégorie A-EUR », « Catégorie AH EUR », « Catégorie R-EUR », « Catégorie RH EUR », « Catégorie C-EUR », « Catégorie D », « Catégorie F », « Catégorie I-EUR », « Catégorie IH EUR », « Catégorie X1-EUR » et « Catégorie X1H-EUR ».

En GBP pour les catégories suivantes : « Catégorie A-GBP », « Catégorie R-GBP », « Catégorie I-GBP » et « Catégorie X1-GBP ».

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 13 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Ce compartiment a été lancé le 19 janvier 2017.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds
sous son nom abrégé ABN AMRO Portfolio High Quality Impact Bonds
sous son nom abrégé ABN AMRO Impact Euro Obligations

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'obligations consolidées durables libellées en euro, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Le compartiment suit une stratégie d'investissement durable multithématique. Le portefeuille sera composé d'émetteurs exposés aux Objectifs de développement durable (ODD) des Nations unies et en tenant compte de la méthodologie Évaluation des solutions ODD (SDGA) d'ISS. Dans le cadre de son objectif d'investissement durable, le compartiment investit dans des émetteurs contribuant positivement aux solutions environnementales et sociales, y compris, mais sans s'y limiter, les obligations vertes et sociales.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des obligations de qualité investment grade et autres titres à taux fixe ou variable libellés en euro. Afin d'atteindre son objectif, le compartiment peut également avoir recours à une variété d'instruments, dont, entre autres, des contrats à terme de taux, des contrats de change à terme (incluant les contrats de change à terme non livrables), des futures de taux d'intérêt, des futures d'obligations et des swaps négociés de gré à gré tels que des swaps de taux d'intérêt, des swaps de défaut de crédit et des stratégies (par exemple, des stratégies axées sur la courbe de rendement et l'arbitrage par le biais d'investissements dans les titres et les instruments dérivés indiqués ci-dessus).

L'allocation d'actifs minimum sur une base consolidée (investissements directs et indirects via l'utilisation d'instruments dérivés) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment sera tenu, pour les 40 % du total de ses actifs nets restants et sur une base consolidée, de respecter toutes les limitations établies au regard des investissements en titres/instruments mentionnés ci-dessous :

- (i) 10 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des obligations à haut rendement ;
- (ii) 25 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des obligations convertibles et autres titres de créance liés à des actions ;
- (iii) un tiers maximum du total des actifs nets du compartiment peut être investi dans des Instruments du marché monétaire, dont, entre autres, des certificats de dépôt, des dépôts à court terme et des dépôts bancaires à vue ;
- (iv) 10 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des valeurs mobilières ;
- (v) 10 % maximum de ses actifs nets peuvent être investis dans des fonds conformes à l'article 9 du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers et qui ont été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs, mais peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des Actifs « distressed » (en difficulté).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment contribue aux objectifs environnementaux et sociaux et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 9 du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers.

L'analyse extra-financière couvre 100 % des titres en portefeuille (la trésorerie n'est pas couverte par l'analyse de durabilité).

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 9.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) à des fins d'investissement, de couverture et de gestion efficace de portefeuille ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds
sous son nom abrégé ABN AMRO Portfolio High Quality Impact Bonds
sous son nom abrégé ABN AMRO Impact Euro Obligaties

gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement

ABN AMRO Investment Solutions

Conseiller externe

ABN AMRO Bank N.V.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque de crédit
- Risque lié aux dérivés
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|-------------------------------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie E | CAP | LU2096463232 « Catégorie E-CAP » | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de ABN AMRO et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| | DIS | LU2096463315 « Catégorie E-DIS » | | Oui | | |
| Catégorie G | CAP | LU2445655066 | Oui | Oui | Investisseurs clients de la Gestion de portefeuille discrétionnaire des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et ayant conclu un accord de commissions spécifique et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU2579956827 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires et OPC | 1 000 000 EUR |
| Catégorie R | DIS | LU2608637208 | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds
sous son nom abrégé ABN AMRO Portfolio High Quality Impact Bonds
sous son nom abrégé ABN AMRO Impact Euro Obligaties

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie E | 0,50% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie G | 0,80% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie I | 0,45% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie R | 0,55% | - | - | 0,18% | 0,05% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie E | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie G | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |
| Catégorie R | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 1 octobre 2020.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

sous son nom abrégé ABN AMRO Private Portfolio Bonds

ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'obligations libellées en euro, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des obligations de qualité investment grade et autres titres à taux fixe ou variable libellés en euro. Afin d'atteindre son objectif, le compartiment peut également avoir recours à une variété d'instruments, dont, entre autres, des contrats à terme de taux, des contrats de change à terme (incluant les contrats de change à terme non livrables), des futures de taux d'intérêt et des futures d'obligations et des stratégies (par exemple, des stratégies axées sur la courbe de rendement et l'arbitrage par le biais d'investissements dans les titres et les instruments dérivés indiqués ci-dessus). L'allocation d'actifs minimum sur une base consolidée (investissements directs et indirects) aux titres investment grade représentera 60 % des actifs nets du compartiment.

Les restrictions suivantes s'appliquent au compartiment :

| | |
|---|------|
| - Exposition minimale à des obligations de qualité investment grade : | 60 % |
| - Exposition maximale aux obligations convertibles : | 15 % |
| - Exposition maximale aux titres de créance à haut rendement et des marchés émergents : | 10 % |
| - Exposition maximale aux titres de créance des marchés émergents : | 10 % |
| - Exposition maximale au risque de change : | 20 % |
| - Allocation maximale aux actions : | 10% |

L'allocation aux actions sera le résultat de la conversion des obligations convertibles en actions. Le gestionnaire n'est pas autorisé à acheter activement des titres de capital.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs, mais peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des Actifs « distressed » (en difficulté).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 70 % du portefeuille.

Le compartiment investira uniquement dans des fonds externes qui sont considérés comme relevant de l'article 8 ou de l'article 9 du règlement SFDR ou détenteurs d'un label de durabilité européen. Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés. Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) à des fins d'investissement et de couverture ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds sous son nom abrégé ABN AMRO Private Portfolio Bonds

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

La méthode de calcul du Portefeuille de référence est disponible sur le site Internet suivant : www.bloomberg.com.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement

ABN AMRO Investment Solutions

Conseiller externe

ABN AMRO Bank N.V. Succursale belge

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque de crédit
- Risque lié aux dérivés
- Risque de liquidité
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU2229462127 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| | DIS | LU2229462390 | | Oui | | |
| Catégorie B | CAP | LU2229462473 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| | DIS | LU2229462556 | | Oui | | |
| Catégorie I | CAP | LU2229462630 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |
| | DIS | LU2229462713 | | Oui | | |

⁽¹⁾ Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,00% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie B | 0,60% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie I | 0,50% | - | - | 0,15% | 0,01% |

⁽¹⁾ La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds
sous son nom abrégé ABN AMRO Private Portfolio Bonds

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie B | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 9 juillet 2021.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities **sous son nom abrégé ABN AMRO Private Portfolio Equities**

ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions mondiales, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières de sociétés situées dans le monde entier (hors marchés émergents) et de tout secteur économique. Le compartiment investira un minimum de 85 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Les restrictions suivantes s'appliquent au compartiment :

- Exposition minimale aux actions européennes (hors marchés émergents) : 30 %
- Exposition maximale aux marchés émergents : 20 %
- Exposition maximale aux sociétés de petite et moyenne capitalisations : 20%

Le compartiment ne sera pas directement exposé aux actions de Chine continentale (mais une exposition indirecte est possible par le biais d'investissements dans d'autres fonds (qui sont limités à 10 % des actifs nets)).

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment peut également investir dans des titres de créance (tels que des obligations à taux fixe et variable, des Instruments du marché monétaire, y compris des obligations à haut rendement) à concurrence de 10 % de ses actifs nets, notamment à des fins de gestion de trésorerie.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 70 % du portefeuille.

Le compartiment investira uniquement dans des fonds externes qui sont considérés comme relevant de l'article 8 ou de l'article 9 du règlement SFDR ou détenteurs d'un label de durabilité européen. Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut avoir recours à des positions non complexes sur instruments financiers dérivés ou utiliser des instruments financiers dérivés uniquement à des fins de couverture.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures d'indices d'action et les futures de change),
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Private Portfolio Equities

La méthode de calcul du Portefeuille de référence est disponible sur le site Internet suivant : www.msci.com.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement

ABN AMRO Investment Solutions

Conseiller externe

ABN AMRO Bank N.V. Succursale belge

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque opérationnel et risque de conservation
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risque lié aux dérivés
- Risque de liquidité
- Risque de contrepartie
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU2229462804 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| | DIS | LU2229462986 | | Oui | | |
| Catégorie B | CAP | LU2229463018 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| | DIS | LU2229463109 | | Oui | | |
| Catégorie I | CAP | LU2229463281 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |
| | DIS | LU2229463364 | | Oui | | |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,90% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie B | 1,50% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie I | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie B | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Private Portfolio Equities

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 9 juillet 2021

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

sous son nom abrégé ABN AMRO Putnam US ESG Equities

ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions durables américaines, en sélectionnant des sociétés de croissance qui respectent les critères de responsabilité environnementale, sociale et de gouvernance (« ESG »), sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières, des sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique aux États-Unis d'Amérique.

L'allocation d'actifs minimum sur une base consolidée (investissements directs et indirects via l'utilisation d'instruments dérivés) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % en ADR/GDR.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des OPCVM éligibles sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les OPCVM éligibles ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment peut également investir dans des titres de créance (tels que des obligations à taux fixe et variable, des Instruments du marché monétaire, y compris des obligations à haut rendement) à concurrence de 10 % de ses actifs nets, notamment à des fins de gestion de trésorerie.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

Le processus de sélection signifie le retrait, au minimum, des 20 % de sociétés les moins performantes de l'univers d'investissement.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+. À cet égard, le Gestionnaire de portefeuille externe n'investit pas dans des sociétés qui ont une implication stratégique dans le cycle de l'énergie nucléaire (seuil de plus de 5 % du chiffre d'affaires).

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures d'indices d'action et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Putnam US ESG Equities

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

The Putnam Advisory Company, LLC

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque lié aux bons de souscription
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU2546365920 « Catégorie A-EUR » LU2546367975 « Catégorie A-USD » | Oui | Non | Tous | 100 EUR 100 USD |
| Catégorie R | CAP | LU2546367892 « Catégorie R-EUR » LU2546367629 « Catégorie R-USD » | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR 100 USD |
| Catégorie C | CAP | LU2546367546 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU2546367462 « Catégorie I-USD » LU2546367389 « Catégorie I-EUR » | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 USD 1 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,50% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie R | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie I | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Putnam US ESG Equities

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie R | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'USD est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En USD pour les catégories suivantes : « Catégorie A-USD », « Catégorie R-USD » et « Catégorie I-USD ».

En EUR pour les catégories suivantes : « Catégorie A-EUR », « Catégorie R-EUR », « Catégorie C » et « Catégorie I-EUR ».

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 13 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 14 décembre 2022.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Pzena European Equities

sous son nom abrégé ABN AMRO Pzena European Equities

ABN AMRO Funds Pzena European Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions européennes, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré activement selon une approche de sélection de titres/purement ascendante qui combine sélection quantitative et analyse fondamentale approfondie, afin de détecter les sociétés, avec des modèles économiques solides et simples, présentant une forte décote en matière de valorisation, selon le gestionnaire d'investissement. Il en résulte un portefeuille plutôt concentré axé sur les opportunités de grande valeur (comprenant généralement entre 40 et 50 avoirs, cette fourchette pouvant toutefois varier en fonction des conditions du marché) qui présente les convictions les plus fortes de l'équipe dans des sociétés de moyenne et grande capitalisations. Le portefeuille du compartiment peut s'écarter considérablement du secteur du Portefeuille de référence et des pondérations des pays.

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières de, sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique en Europe.

L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. Le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Les investissements en titres de créance n'excéderont pas 15 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

En vertu des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance de ManCo et conformément aux Principes pour l'investissement responsable des Nations Unies, le compartiment exclut tout investissement direct dans des titres émis par des sociétés impliquées dans des activités hautement controversées (telles que la production de tabac et d'armes controversées) et/ou en violation grave des principes du Pacte mondial des Nations Unies.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Pzena Investment Management, LLC.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque opérationnel et risque de conservation
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risque lié aux bons de souscription

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

ABN AMRO Funds Pzena European Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Pzena European Equities

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|--------------|----------------|--|----------------|------------|---|--|
| Catégorie A | CAP DIS | LU0849850408 « Catégorie A-EUR » LU1670607149 « Catégorie A-SEK » LU1890797704 « Catégorie A-USD » LU1313464684 « Catégorie A-GBP » | Oui | Non | Tous | 100 EUR 1 000 SEK 100 USD 100 GBP |
| Catégorie R | CAP | LU1670607495 « Catégorie R-EUR » LU1890797886 « Catégorie R-USD » | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR 100 USD |
| | DIS CAP | LU2075325501 « Catégorie R-EUR DIS » LU1670607578 « Catégorie R-GBP » LU1890797456 | | Oui Non | | 100 EUR 100 GBP 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU0849850580 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie D | CAP | LU1406019262 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1329507419 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neulize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU0949827314 « Catégorie I-EUR » LU1670607222 « Catégorie I-SEK » LU1890797969 « Catégorie I-USD » | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR 10 000 000 SEK 1 000 000 USD |
| | DIS CAP | LU1313464924 « Catégorie I-GBP » LU2474253817 « Catégorie I-EUR » LU1890797530 | | Oui Non | | 1 000 000 GBP 1 000 000 EUR 1 000 000 EUR |
| Catégorie S1 | DIS | LU1890797613 | Oui | Non | Investisseurs autorisés | 20 000 000 EUR |
| Catégorie X1 | CAP | LU2613669592 | Oui | Non | Investisseurs autorisés | 50 000 000 EUR |
| Catégorie Z | CAP | LU1670607651 | Oui | Non | Investisseurs autorisés | 100 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

ABN AMRO Funds Pzena European Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Pzena European Equities

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|--------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,50% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie R | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie I | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |
| Catégorie S1 | 0,75% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie X1 | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |
| Catégorie Z | 0,00% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|--------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie R | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |
| Catégorie S1 | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie X1 | - | - | - |
| Catégorie Z | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En EUR pour les catégories suivantes : « Catégorie A-EUR », « Catégorie R-EUR », « Catégorie C », « Catégorie D », « Catégorie F », « Catégorie I-EUR », « Catégorie S1 », « Catégorie Z » et « Catégorie X1 ».

En GBP pour les catégories suivantes : « Catégorie A-GBP », « Catégorie R-GBP » et « Catégorie I-GBP ».

En SEK pour les catégories suivantes : « Catégorie A-SEK » et « Catégorie I-SEK ».

En USD pour les catégories suivantes : « Catégorie A-USD », « Catégorie R-USD » et « Catégorie I-USD ».

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

ABN AMRO Funds Pzena European Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Pzena European Equities

Données historiques :

Ce compartiment a été lancé le 4 avril 2013.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Pzena US Equities

sous son nom abrégé ABN AMRO Pzena US Equities

ABN AMRO Funds Pzena US Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions américaines, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré activement selon une approche de sélection de titres pure/ascendante qui combine sélection quantitative et analyse fondamentale approfondie, afin de détecter les sociétés avec des modèles économiques solides et simples qui, selon le gestionnaire d'investissement, présentent une forte décote en matière de valorisation. Il en résulte un portefeuille ciblé axé sur les opportunités de grande valeur (comprenant généralement entre 30 et 40 avoirs, cette fourchette pouvant toutefois varier en fonction des conditions du marché) qui présente les convictions les plus fortes de l'équipe dans des sociétés de moyenne et grande capitalisations.

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières tels que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières, de sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique en Amérique du Nord.

L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Les investissements en titres de créance n'excéderont pas 15 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

En vertu des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance de ManCo et conformément aux Principes pour l'investissement responsable des Nations Unies, le compartiment exclut tout investissement direct dans des titres émis par des sociétés impliquées dans des activités hautement controversées (telles que la production de tabac et d'armes controversées) et/ou en violation grave des principes du Pacte mondial des Nations Unies.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Pzena Investment Management, LLC.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque lié aux bons de souscription

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

ABN AMRO Funds Pzena US Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Pzena US Equities

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|------------------|----------------|---|----------------|------------|---|--|
| Catégorie A | CAP | LU0979881538 « Catégorie A-EUR » LU0979881611 « Catégorie A-USD » LU1670607735 « Catégorie A-SEK » | Oui | Non | Tous | 100 EUR 100 USD 1 000 SEK |
| | DIS | LU1890798934 « Catégorie A-GBP » | | Oui | | 100 GBP |
| Catégorie AH EUR | CAP | LU1890798009 | | Non | | 100 EUR |
| Catégorie R | CAP | LU1670608113 « Catégorie R-EUR » LU1670608469 « Catégorie R-USD » | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR 100 USD |
| | DIS | LU1670608204 « Catégorie R-GBP » | | Oui | | 100 GBP |
| Catégorie RH EUR | CAP | LU1890798348 | | Non | | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU0979881702 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie D | CAP | LU1406019346 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1329508573 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neufelize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU0979881884 « Catégorie I-USD » LU1670607909 « Catégorie I-EUR » LU1670608030 « Catégorie I-SEK » | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 USD 1 000 000 EUR 10 000 000 SEK |
| | DIS | LU1670607818 « Catégorie I-GBP » | | Oui Non | | 1 000 000 GBP |
| Catégorie IH EUR | CAP | LU1670608626 | | | | 1 000 000 EUR |
| Catégorie X1 | CAP | LU2337064427 | Oui | | Investisseurs autorisés | 50 000 000 USD |
| Catégorie Z | CAP | LU1670608543 | Oui | | Investisseurs autorisés | 100 000 000 USD |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

ABN AMRO Funds Pzena US Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Pzena US Equities

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|----------------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégories A, AH EUR | 1,50% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégories R, RH EUR | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégories I, IH EUR | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |
| Catégorie X1 | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |
| Catégorie Z | 0,00% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|----------------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégories A, AH EUR | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégories R, RH EUR | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégories I, IH EUR | - | - | - |
| Catégorie X1 | - | - | - |
| Catégorie Z | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'USD est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En USD pour les catégories suivantes : « Catégorie A-USD », « Catégorie R-USD », « Catégorie I-USD », « Catégorie X1 » et « Catégorie Z ».

En EUR pour les catégories suivantes : « Catégorie A-EUR », « Catégorie AH EUR », « Catégorie R-EUR », « Catégorie RH EUR », « Catégorie C », « Catégorie D », « Catégorie F », « Catégorie I-EUR » et « Catégorie IH EUR ».

En GBP pour les catégories suivantes : « Catégorie A-GBP », « Catégorie R-GBP » et « Catégorie I-GBP ».

En SEK pour les catégories suivantes : « Catégorie A-SEK » et « Catégorie I-SEK ».

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 13 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

ABN AMRO Funds Pzena US Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Pzena US Equities

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Ce compartiment a été lancé le 5 décembre 2013.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

sous son nom abrégé ABN AMRO Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Objectif d'investissement

Fournir une croissance du capital à moyen terme avec un portefeuille d'obligations d'État de qualité investment grade diversifié et activement géré d'obligations, sans aucune restriction spécifique à l'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment investit principalement dans des obligations d'État et des titres considérés comme des produits équivalents aux obligations tels que des obligations à revenu fixe et à taux variable, libellés en euro et de qualité investment grade, émis ou garantis par un État membre de l'Union européenne appartenant à la zone euro ainsi que dans des dérivés de ce type d'actifs.

Le compartiment allouera un minimum de 60 % de ses actifs nets à de tels titres.

Si un titre est rétrogradé au niveau des titres de qualité inférieure à investment grade ou en difficulté, le compartiment le détiendra en portefeuille jusqu'à 10 % maximum. Si cette limite est dépassée, le titre sera vendu le plus rapidement possible en agissant au mieux des intérêts des investisseurs du compartiment.

Outre les limitations susmentionnées, le compartiment sera tenu, pour les 40 % du total de ses actifs nets restants et sur une base consolidée de respecter toutes les limitations indiquées à continuation au regard des investissements en titres/instruments mentionnés ci-après pouvant être regroupés jusqu'à hauteur d'un tiers du total de ses actifs nets.

- (i) 40 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans d'autres obligations libellées en euros et non libellées en euros de qualité investment grade ;
- (ii) un tiers maximum du total des actifs nets du compartiment peut être investi dans des instruments du marché monétaire ;
- (iii) 10 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans d'autres actions ou parts d'OPCVM ou d'OPC.

Les restrictions suivantes s'appliquent également au compartiment :

- Exposition maximale aux titres non notés : 10 %
- Duration : +/- 2 ans (comparé au Portefeuille de référence)
- Exposition maximale au risque de change : 10 %

Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 90 % du portefeuille.

Le processus de sélection ESG (exclusions et filtres ESG) entraînera la suppression des investissements d'au moins 20 % de l'univers initial, car ces investissements ne seront pas éligibles (exclusions, niveau des notations ESG).

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) à des fins d'investissement, de couverture et de gestion efficace de portefeuille ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins d'investissement en devises, de couverture de change et de gestion efficace du portefeuille (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds sous son nom abrégé ABN AMRO Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Robeco Institutional Asset Management B.V.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque lié aux dérivés
- Risque de durabilité
- Risques liés aux obligations à haut rendement

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1577879775 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie C | DIS | LU1577879858 | Oui | Oui | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie D | CAP | LU1577880195 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1577880278 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neulize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 0,60% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,35% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,35% | - | - | 0,18 % | 0,05 % |
| Catégorie F | 0,35% | - | - | 0,18% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

**ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds
sous son nom abrégé ABN AMRO Robeco Euro ESG Government-Related Bonds**

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Date de lancement :

Données historiques :

Ce compartiment a été lancé le 30 octobre 2017.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities

sous son nom abrégé ABN AMRO Sands Emerging Markets Equities

ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions des marchés émergents libellées en euro, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré selon une approche fondamentale ascendante/de sélection de titres axée sur les entreprises. L'objectif consiste à identifier des sociétés à croissance de qualité supérieure qui dominent des secteurs de croissance attractifs. Il en résulte un portefeuille plutôt concentré (40 titres, mais cela peut varier en fonction des conditions de marché) investi principalement dans des grandes capitalisations, qui reflète les convictions les plus fortes de l'équipe. Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives ou les bons de souscription de valeurs mobilières émises par des sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique dans les marchés émergents.

L'allocation d'actifs minimum sur une base consolidée (investissements directs et indirects via l'utilisation d'instruments dérivés) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Les investissements en titres de créance n'excéderont pas 10 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 75 % du portefeuille.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % du total de ses actifs nets dans des Fonds passifs externes et/ou des ETF qui relèvent de l'article 6 du règlement SFDR. Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures d'indices d'action et les futures de change) à des fins d'investissement, de couverture et de gestion efficace de portefeuille ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Sands Capital Management, LLC.

ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Sands Emerging Markets Equities

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque opérationnel et risque de conservation
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risque lié aux bons de souscription
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|--------------|----------------|--|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU2054455527 « Catégorie A-EUR » LU2054455790 « Catégorie A-USD » | Oui | Non | Tous | 100 EUR 100 USD |
| | DIS | LU2054455873 « Catégorie A-GBP » | | Oui | | 100 GBP |
| Catégorie R | CAP | LU2054455956 « Catégorie R-EUR » LU2054456095 « Catégorie R-USD » | Oui | Non | Investisseurs clients d'intermédiaires financiers ou de sociétés de services interdits de retenir les aides à l'investissement et investisseurs autorisés | 100 EUR 100 USD |
| | DIS | LU2054456178 « Catégorie R-GBP » | | Oui | | 100 GBP |
| Catégorie C | CAP | LU2054456418 « Catégorie C-EUR » LU2054456509 « Catégorie C-USD » | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR 5 000 USD |
| Catégorie D | CAP | LU2054456681 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU2054456764 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neulize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU2054456848 « Catégorie I-EUR » | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |
| | | LU2054456921 « Catégorie I-USD » | | | | 1 000 000 USD |
| Catégorie IH | CAP | LU2474253908 « Catégorie IH-EUR » | Oui | Non | | 1 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Sands Emerging Markets Equities

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|--------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 2,00% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégorie R | 1,10% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégorie C | 1,10% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégorie D | 1,10% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégorie F | 1,10% | - | - | 0,25 % | 0,01% |
| Catégorie I | 1,00% | - | - | 0,20% | 0,01% |
| Catégorie IH | 1,00% | - | - | 0,20% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|--------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie R | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |
| Catégorie IH | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'USD est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En USD pour les catégories suivantes : « Catégorie A-USD », « Catégorie R-USD », « Catégorie C-USD » et « Catégorie I-USD ».

En EUR pour les catégories suivantes : « Catégorie A-EUR », « Catégorie R-EUR », « Catégorie C-EUR », « Catégorie D », « Catégorie F », « Catégorie I-EUR » et « Catégorie IH-EUR ».

En GBP pour les catégories suivantes : « Catégorie A-GBP » et « Catégorie R-GBP ».

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|--|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Trois jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+3) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 22 mai 2020.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux investisseurs potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leurs investissements.

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds

sous son nom abrégé ABN AMRO Schroder Euro Corporate ESG Bonds

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'obligations d'entreprises libellées en euro, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi. Le compartiment utilise une sélection de titres respectant les critères de responsabilité environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG). Le portefeuille est composé d'émetteurs qui sont soit des leaders dans les bonnes pratiques ESG, soit attractifs en raison de leur progression sur les questions ESG.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré activement selon un processus associant une analyse des thèmes macroéconomiques à une sélection de titres ascendante. Il en résulte un portefeuille combinant des sources d'alpha non corrélées afin d'atténuer le risque.

Le compartiment investit principalement dans des obligations d'entreprises de qualité investment grade et autres titres à taux fixe ou variable libellés en euro. Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le compartiment peut également avoir recours à une variété d'instruments/de stratégies, dont, entre autres, des contrats à terme de taux, des contrats de change à terme (incluant les contrats de change à terme non livrables), des futures de taux d'intérêt, des futures d'obligations et des swaps négociés de gré à gré tels que des swaps de taux d'intérêt et des swaps de défaut de crédit.

L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment sera tenu, pour les 40 % du total de ses actifs nets restants et sur une base consolidée, de respecter toutes les limitations établies au regard des investissements en titres/instruments mentionnés ci-dessous :

- (i) 25 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des obligations convertibles et autres titres de créance liés à des actions ;
- (ii) un tiers maximum du total des actifs nets du compartiment peut être investi dans des instruments du marché monétaire, dont, entre autres, des certificats de dépôt, des dépôts à court terme et des dépôts bancaires à vue ;
- (iii) 10 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des valeurs mobilières ;
- (iv) 10 % maximum des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 90 % du portefeuille. Le processus de sélection ESG (exclusions et filtres ESG) entraînera la suppression des investissements d'au moins 20 % de l'univers initial, car ces investissements ne seront pas éligibles (exclusions, niveau des notations ESG).

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) à des fins d'investissement, de couverture et de gestion efficace de portefeuille ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds sous son nom abrégé ABN AMRO Schroder Euro Corporate ESG Bonds

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

La méthode de calcul du Portefeuille de référence est disponible sur le site Internet suivant : www.markit.com.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Schroder Investment Management (Europe) S.A. – succursale allemande à laquelle Schroder Investment Management Ltd. a délégué la gestion d'investissement du portefeuille

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU0979879557 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU0979879631 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| | DIS | LU2631872376 | Oui | Oui | | |
| Catégorie D | CAP | LU1670610796 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1329508490 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neufelize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU0979879987 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|-------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 0,70% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie I | 0,35% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds sous son nom abrégé ABN AMRO Schroder Euro Corporate ESG Bonds

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription ⁽²⁾ | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat ⁽²⁾ |
|-------------|---|---|-------------------------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Ce compartiment a été lancé le 5 décembre 2013.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged sous son nom abrégé ABN AMRO Schroder Euro Corporate ESG Bonds DH

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'obligations d'entreprises libellées en euro, sans restriction spécifique à l'écart de suivi et chercher également à minimiser l'impact de la hausse des taux d'intérêt sur les rendements. Le compartiment utilise une sélection de titres respectant les critères de responsabilité environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG). Le portefeuille est composé d'émetteurs qui sont soit des leaders dans les bonnes pratiques ESG, soit attractifs en raison de leur progression sur les questions ESG.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré activement selon un processus associant une analyse des thèmes macroéconomiques à une sélection de titres ascendante. Il en résulte un portefeuille combinant des sources d'alpha non corrélées afin d'atténuer le risque.

Le compartiment investit principalement dans des obligations d'entreprises de qualité investment grade et autres titres à taux fixe ou variable libellés en euro. Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le compartiment peut également avoir recours à une variété d'instruments/de stratégies, dont, entre autres, des contrats à terme de taux, des contrats de change à terme (incluant les contrats de change à terme non livrables), des futures de taux d'intérêt, des futures d'obligations et des swaps négociés de gré à gré tels que des swaps de taux d'intérêt et des swaps de défaut de crédit.

L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment sera tenu, pour les 40 % du total de ses actifs nets restants et sur une base consolidée, de respecter toutes les limitations établies au regard des investissements en titres/instruments mentionnés ci-dessous :

- (i) 25 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des obligations convertibles et autres titres de créance liés à des actions ;
- (ii) un tiers maximum du total des actifs nets du compartiment peut être investi dans des instruments du marché monétaire, dont, entre autres, des certificats de dépôt, des dépôts à court terme et des dépôts bancaires à vue ;
- (iii) 10 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des valeurs mobilières ;
- (iv) 10 % maximum de ses actifs nets peuvent être investis dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Le compartiment cherchera à réduire la durée dans une mesure équivalente à la durée de son Portefeuille de référence par le biais de dérivés cotés. Le portefeuille peut rester exposé à un certain risque de durée correspondant à la prise de risque active du gestionnaire.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 90 % du portefeuille. Le processus de sélection ESG (exclusions et filtres ESG) entraînera la suppression des investissements d'au moins 20 % de l'univers initial, car ces investissements ne seront pas éligibles (exclusions, niveau des notations ESG).

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) à des fins d'investissement, de couverture et de gestion efficace de portefeuille ;

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged sous son nom abrégé ABN AMRO Schroder Euro Corporate ESG Bonds DH

- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

La méthode de calcul du Portefeuille de référence est disponible sur le site Internet suivant : www.theice.com.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement externe

Schroder Investment Management (Europe) S.A. – succursale allemande à laquelle Schroder Investment Management Ltd. a délégué la gestion d'investissement du portefeuille

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1253567454 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU0979879714 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie D | CAP | LU1733877333 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1733877416 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neufelize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|-------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 0,70% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,01% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged sous son nom abrégé ABN AMRO Schroder Euro Corporate ESG Bonds DH

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription ⁽²⁾ | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat ⁽²⁾ |
|-------------|---|---|-------------------------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Les « Catégorie A » et « Catégorie C » ont été lancées le 9 mars 2018 à la suite de leur fusion avec tous les actifs et passifs des « Catégorie AH DUR » et « Catégorie CH DUR » respectivement du compartiment « ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate Bonds » de la Société.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities **sous son nom abrégé ABN AMRO Walter Scott European ESG Equities**

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions européennes, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi. Le compartiment utilise une sélection de titres respectant les critères de responsabilité environnementaux, sociaux et de gouvernance (« ESG »). Le portefeuille est composé d'émetteurs qui sont soit des leaders dans les pratiques ESG, soit attractifs en raison de leur progression sur les questions ESG.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré selon une approche fondamentale et ascendante sur le long terme qui s'appuie sur la capitalisation des rendements. Le compartiment vise à investir dans des sociétés générant des taux de rendement internes élevés, disponibles à des prix d'achat raisonnables.

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières de, sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique en Europe.

L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment peut également investir dans des titres de créance (tels que des obligations à taux fixe et variable, des Instruments du marché monétaire, y compris des obligations à haut rendement) à concurrence de 10 % de ses actifs nets, notamment à des fins de gestion de trésorerie.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 90 % du portefeuille. Le processus de sélection ESG (exclusions et filtres ESG) entraînera la suppression des investissements d'au moins 20 % de l'univers initial.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures d'indices d'action et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Walter Scott European ESG Equities

Gestionnaire d'investissement externe

Walter Scott & Partners Limited

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risque lié aux bons de souscription
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU2281296587 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU2281296660 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie D | CAP | LU2281296744 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU2281296827 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neulize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU2281297049 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,50% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie I | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Walter Scott European ESG Equities

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 11 mars 2021.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

LIVRE II DU PROSPECTUS
—
FONDS SOUS MANDAT

ABN AMRO Funds Fund of Mandates-Pacific Equities

sous son nom abrégé AAF FoM Pacific Equities

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Pacific Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de stratégies basées sur des titres de la région Pacifique, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré activement en investissant dans diverses stratégies déléguées à plusieurs gestionnaires d'investissement. Le compartiment permet une allocation entre différents styles et stratégies de capitalisations boursières dans la région Pacifique. Le processus de sélection de ces Gestionnaires d'investissement externes repose sur une analyse quantitative des risques et des rendements, sur une évaluation qualitative autour de cinq piliers (équipe de direction, équipe de recherche, philosophie, processus et gestion du risque) et sur la due diligence opérationnelle.

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières, de sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique dans la région Pacifique.

L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % de son actif net dans des actions chinoises (Actions A), libellées en CNH, qui sont cotées sur la Bourse de Hong Kong via le Shanghai-Hong Kong et Shenzhen Stock Connect.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Les investissements en titres de créance n'excéderont pas 15 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

En vertu des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance de ManCo et conformément aux Principes pour l'investissement responsable des Nations Unies, le compartiment exclut tout investissement direct dans des titres émis par des sociétés impliquées dans des activités hautement controversées (telles que la production de tabac et d'armes controversées) et/ou en violation grave des principes du Pacte mondial des Nations Unies.

Relation avec le Portefeuille de référence

Le compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Le choix des stratégies sous-jacentes et la composition du portefeuille ne sont pas définis ou limités par les composantes du Portefeuille de référence. Le gérant ne cherchera pas à limiter le niveau d'écart du portefeuille par rapport au Portefeuille de référence, mais étant donné que le compartiment combinera plusieurs stratégies actives de manière discrétionnaire, le profil de risque et de rendement du compartiment sera comparable à celui du Portefeuille de référence. Le rendement attendu de l'écart entre le fonds et le Portefeuille de référence (l'écart de suivi) du compartiment sera modéré.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque opérationnel et risque de conservation
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risques liés aux investissements en Asie
- Risque lié aux bons de souscription
- Risques spécifiques liés aux investissements en Chine

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates-Pacific Equities sous son nom abrégé AAF FoM Pacific Equities

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU0321539412 « Catégorie A-EUR » LU0321538521 « Catégorie A-USD » | Oui | Non | Tous | 100 EUR 100 USD |
| Catégorie C | CAP | LU0756530183 « Catégorie C-EUR » LU1075916053 « Catégorie C-USD » | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR 5 000 USD |
| Catégorie D | CAP | LU1670611844 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1329513144 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neuflyze OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|--------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 2,00% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégories C | 1,10% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégorie D | 1,10% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégorie F | 1,10% | - | - | 0,25 % | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|--------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégories C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'USD est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En USD pour les catégories suivantes : « Catégorie A-USD » et « Catégorie C-USD »

En EUR pour les catégories suivantes : « Catégorie A-EUR », « Catégorie C-EUR », « Catégorie D » et « Catégorie F »

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates-Pacific Equities
sous son nom abrégé AAF FoM Pacific Equities

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|--|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Trois jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+3) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 2 novembre 2007.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Emerging Markets Equities

sous son nom abrégé AAF FoM Emerging Markets Equities

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Emerging Markets Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de stratégies basées sur des titres des marchés émergents, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré activement en investissant dans diverses stratégies déléguées à plusieurs gestionnaires d'investissement. Le compartiment permet une allocation entre différents styles et stratégies de capitalisations boursières dans les pays émergents. Le processus de sélection de ces Gestionnaires d'investissement externes repose sur une analyse quantitative des risques et des rendements, sur une évaluation qualitative autour de cinq piliers (équipe de direction, équipe de recherche, philosophie, processus et gestion du risque) et sur une due diligence opérationnelle.

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives ou les bons de souscription de valeurs mobilières émises par des sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique dans les marchés émergents.

L'allocation d'actifs minimum sur une base consolidée (investissements directs et indirects via l'utilisation d'instruments dérivés) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % de son actif net dans des actions chinoises (Actions A), libellées en CNH, qui sont cotées sur la Bourse de Hong Kong via le Shanghai-Hong Kong et Shenzhen Stock Connect.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Les investissements en titres de créance n'excéderont pas 15 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

En vertu des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance de ManCo et conformément aux Principes pour l'investissement responsable des Nations Unies, le compartiment exclut tout investissement direct dans des titres émis par des sociétés impliquées dans des activités hautement controversées (telles que la production de tabac et d'armes controversées) et/ou en violation grave des principes du Pacte mondial des Nations Unies.

Instruments dérivés

Le compartiment peut investir dans des instruments financiers dérivés à des fins d'exposition et de couverture.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures d'indices d'action et les futures de change) à des fins d'investissement, de couverture et de gestion efficace de portefeuille ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Le compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Le choix des stratégies sous-jacentes et la composition du portefeuille ne sont pas définis ou limités par les composantes du Portefeuille de référence. Le gérant ne cherchera pas à limiter le niveau d'écart du portefeuille par rapport au Portefeuille de référence, mais étant donné que le compartiment combinera plusieurs stratégies actives de manière discrétionnaire, le profil de risque et de rendement du compartiment sera comparable à celui du Portefeuille de référence. Le rendement attendu de l'écart entre le fonds et le Portefeuille de référence (l'écart de suivi) du compartiment sera modéré.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Emerging Markets Equities sous son nom abrégé AAF FoM Emerging Markets Equities

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque opérationnel et risque de conservation
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risque lié aux bons de souscription
- Risques spécifiques liés aux investissements en Chine

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1165263440 « Catégorie A-EUR » | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU1165263952 « Catégorie C-EUR » LU1165264174 « Catégorie C-USD » | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR 5 000 USD |
| Catégorie D | CAP | LU1670611760 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1329512252 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neuflyze OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU1165264331 « Catégorie I-EUR » LU1165264505 « Catégorie I-USD » | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR 1 000 000 USD |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 2,00% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégorie C | 1,10% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégorie D | 1,10% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégorie F | 1,10% | - | - | 0,25 % | 0,01% |
| Catégorie I | 1,00% | - | - | 0,20% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Emerging Markets Equities sous son nom abrégé AAF FoM Emerging Markets Equities

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'USD est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En USD pour les catégories suivantes : « Catégorie A-USD », « Catégorie C-USD » et « Catégorie I-USD ».

En EUR pour les catégories suivantes : « Catégorie A-EUR », « Catégorie C-EUR », « Catégorie D », « Catégorie F » et « Catégorie I-EUR ».

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|--|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Trois jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+3) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Ce compartiment a été lancé le 1^{er} avril 2015.

Néant

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

sous son nom abrégé AAF FoM Euro Corporate Bonds

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de stratégies basées sur des obligations d'entreprises libellées en euro, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré activement en investissant dans diverses stratégies déléguées à plusieurs gestionnaires d'investissement. Le compartiment permet une allocation entre différentes stratégies de marché dans l'univers des obligations libellées en euro. Le processus de sélection de ces Gestionnaires d'investissement externes repose sur une analyse quantitative des risques et des rendements, sur une évaluation qualitative autour de cinq piliers (équipe de direction, équipe de recherche, philosophie, processus et gestion du risque) et sur la due diligence opérationnelle.

Le compartiment investit principalement dans des obligations d'entreprises de qualité investment grade et autres titres à taux fixe ou variable libellés en euro et sans contraintes en matière de notation. Afin d'atteindre son objectif, le compartiment peut également avoir recours à une variété d'instruments, dont, entre autres, des contrats à terme de taux, des contrats de change à terme (incluant les contrats de change à terme non livrables), des futures de taux d'intérêt, des futures d'obligations et des swaps négociés de gré à gré tels que des swaps de taux d'intérêt, des swaps de défaut de crédit et des stratégies (par exemple, des stratégies axées sur la courbe de rendement et l'arbitrage par le biais d'investissements dans les titres et les instruments dérivés indiqués ci-dessus).

L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment sera tenu, pour les 40 % du total de ses actifs nets restants et sur une base consolidée, de respecter toutes les limitations établies au regard des investissements en titres/instruments mentionnés ci-dessous :

- (i) 25 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des obligations convertibles et autres titres de créance liés à des actions ;
- (ii) un tiers maximum du total des actifs nets du compartiment peut être investi dans des instruments du marché monétaire, dont, entre autres, des certificats de dépôt, des dépôts à court terme et des dépôts bancaires à vue ;
- (iii) 10 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des valeurs mobilières ;
- (iv) 10 % maximum de ses actifs nets peuvent être investis dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 70 % du portefeuille.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % du total de ses actifs nets dans des Fonds passifs externes et/ou des ETF qui relèvent de l'article 6 du règlement SFDR. Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) à des fins d'investissement, de couverture et de gestion efficace de portefeuille ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds sous son nom abrégé AAF FoM Euro Corporate Bonds

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1165265148 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU1165265494 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie D | CAP | LU1670610440 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1329512419 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neufelize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU1165265908 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|-------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 0,70% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie I | 0,35% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

**ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds
sous son nom abrégé AAF FoM Euro Corporate Bonds**

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription ⁽²⁾ | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat ⁽²⁾ |
|-------------|---|---|-------------------------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Date de lancement :

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 1^{er} avril 2015.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged sous son nom abrégé AAF FoM Euro Corporate Bonds DH

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de stratégies basées sur des obligations d'entreprises libellées en euro, sans restriction spécifique à l'écart de suivi et chercher également à minimiser l'impact de la hausse des taux d'intérêt sur les rendements.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré activement en investissant dans diverses stratégies déléguées à plusieurs gestionnaires d'investissement. Le compartiment permet une allocation entre différentes stratégies de marché dans l'univers des obligations libellées en euro. Le processus de sélection de ces Gestionnaires d'investissement externes repose sur une analyse quantitative des risques et des rendements, sur une évaluation qualitative autour de cinq piliers (équipe de direction, équipe de recherche, philosophie, processus et gestion du risque) et sur la due diligence opérationnelle.

Le compartiment investit principalement dans des obligations d'entreprises de qualité investment grade et autres titres à taux fixe ou variable libellés en euro et sans contraintes en matière de notation. Afin d'atteindre son objectif, le compartiment peut également avoir recours à une variété d'instruments, dont, entre autres, des contrats à terme de taux, des contrats de change à terme (incluant les contrats de change à terme non livrables), des futures de taux d'intérêt, des futures d'obligations et des swaps négociés de gré à gré tels que des swaps de taux d'intérêt, des swaps de défaut de crédit et des stratégies (par exemple, des stratégies axées sur la courbe de rendement et l'arbitrage par le biais d'investissements dans les titres et les instruments dérivés indiqués ci-dessus).

L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment sera tenu, pour les 40 % du total de ses actifs nets restants et sur une base consolidée, de respecter toutes les limitations établies au regard des investissements en titres/instruments mentionnés ci-dessous :

- (i) 25 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des obligations convertibles et autres titres de créance liés à des actions ;
- (ii) un tiers maximum du total des actifs nets du compartiment peut être investi dans des instruments du marché monétaire, dont, entre autres, des certificats de dépôt, des dépôts à court terme et des dépôts bancaires à vue ;
- (iii) 10 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des valeurs mobilières ;
- (iv) 10 % maximum de ses actifs nets peuvent être investis dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Le compartiment cherchera à réduire la duration dans une mesure équivalente à la duration de son Portefeuille de référence par le biais de dérivés cotés. Le portefeuille peut rester exposé à un certain risque de duration correspondant à la prise de risque active du gestionnaire.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 70 % du portefeuille.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % du total de ses actifs nets dans des Fonds passifs externes et/ou des ETF qui relèvent de l'article 6 du règlement SFDR. Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged sous son nom abrégé AAF FoM Euro Corporate Bonds DH

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) à des fins d'investissement, de couverture et de gestion efficace de portefeuille ;

- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1253565755 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie C | CAP | LU1165265650 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie D | CAP | LU1733877507 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1733877689 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neufelize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|-------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 0,70% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie C | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,40% | - | - | 0,18% | 0,01% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged sous son nom abrégé AAF FoM Euro Corporate Bonds DH

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription ⁽²⁾ | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat ⁽²⁾ |
|-------------|---|---|-------------------------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Les « Catégorie A » et « Catégorie C » ont été lancées le 9 mars 2018 à la suite de leur fusion avec tous les actifs et passifs des « Catégorie AH DUR » et « Catégorie CH DUR » respectivement du compartiment « ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds » de la Société.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates North American Equities

sous son nom abrégé AAF FoM North American Equities

ABN AMRO Funds Fund of Mandates North American Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de stratégies basées sur des actions américaines, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré activement en investissant dans diverses stratégies déléguées à plusieurs gestionnaires d'investissement. Le compartiment permet une allocation entre différents styles et stratégies de capitalisations boursières en Amérique du Nord. Le processus de sélection de ces Gestionnaires d'investissement externes repose sur une analyse quantitative des risques et des rendements, sur une évaluation qualitative autour de cinq piliers (équipe de direction, équipe de recherche, philosophie, processus et gestion du risque) et sur la due diligence opérationnelle.

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières tels que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières, de sociétés qui sont domiciliées ou exercent une partie prépondérante de leur activité économique en Amérique du Nord.

L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir un maximum de 10 % de ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Les investissements en titres de créance n'excéderont pas 15 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

En vertu des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance de ManCo et conformément aux Principes pour l'investissement responsable des Nations Unies, le compartiment exclut tout investissement direct dans des titres émis par des sociétés impliquées dans des activités hautement controversées (telles que la production de tabac et d'armes controversées) et/ou en violation grave des principes du Pacte mondial des Nations Unies.

Relation avec le Portefeuille de référence

Le compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Le choix des stratégies sous-jacentes et la composition du portefeuille ne sont pas définis ou limités par les composantes du Portefeuille de référence. Le gérant ne cherchera pas à limiter le niveau d'écart du portefeuille par rapport au Portefeuille de référence, mais étant donné que le compartiment combinera plusieurs stratégies actives de manière discrétionnaire, le profil de risque et de rendement du compartiment sera comparable à celui du Portefeuille de référence. Le rendement attendu de l'écart entre le fonds et le Portefeuille de référence (l'écart de suivi) du compartiment sera modéré.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque lié aux bons de souscription

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

**ABN AMRO Funds Fund of Mandates North American Equities
sous son nom abrégé AAF FoM North American Equities**

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|------------------|----------------|--|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU0321538950 « Catégorie A-EUR » LU0321538281 « Catégorie A-USD » | Oui | Non | Tous | 100 EUR 100 USD |
| Catégorie C | CAP | LU0756530696 « Catégorie C-EUR » LU1075916210 « Catégorie C-USD » | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR 5 000 USD |
| Catégorie CH EUR | CAP | LU0756530779 | Oui | Non | | 5 000 EUR |
| Catégorie D | CAP | LU1670609517 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1329512849 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neufelize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU1165272516 « Catégorie I-EUR » | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|----------------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,50% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégories C, CH EUR | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie D | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégorie I | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|----------------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégories C, CH EUR | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie D | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | Néant | Néant | Néant |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'USD est la devise de libellé du compartiment.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates North American Equities
sous son nom abrégé AAF FoM North American Equities

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En USD pour les catégories suivantes : « Catégorie A-USD » et « Catégorie C-USD »

En EUR pour les catégories suivantes : « Catégorie A-EUR », « Catégorie C-EUR », « Catégorie CH EUR », « Catégorie D », « Catégorie F » et « Catégorie I-EUR ».

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 13 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 2 novembre 2007.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds

sous son nom abrégé AAF Portfolio Flexible Bonds

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de stratégies basées sur des obligations, y compris des obligations des marchés émergents et des obligations à haut rendement, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré activement en investissant dans diverses stratégies déléguées à plusieurs gestionnaires d'investissement. Le compartiment permet une allocation entre différentes stratégies de marché et zones géographiques dans l'univers des obligations. Le processus de sélection de ces Gestionnaires d'investissement externes repose sur une analyse quantitative des risques et des rendements, sur une évaluation qualitative autour de cinq piliers (équipe de direction, équipe de recherche, philosophie, processus et gestion du risque) et sur la due diligence opérationnelle.

Le compartiment investit principalement (entre 0 et 100 % de ses actifs nets) et de manière discrétionnaire dans des titres de créance d'émetteurs (qui ne sont soumis à aucune contrainte en matière de notation) situés dans le monde entier, y compris dans les marchés émergents et dans des obligations à haut rendement. Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le compartiment peut également avoir recours à une variété d'instruments/stratégies, dont, entre autres, des instruments du marché monétaire, des obligations convertibles, des contrats à terme de taux, des contrats de change à terme (incluant les contrats de change à terme non livrables), des futures de taux d'intérêt, des futures d'obligations et des swaps négociés de gré à gré tels que des swaps de taux d'intérêt et des swaps de défaut de crédit.

L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment sera tenu, pour les 40 % du total de ses actifs nets restants et sur une base consolidée, de respecter toutes les limitations établies au regard des investissements en titres/instruments mentionnés ci-dessous :

- (i) 10 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des valeurs mobilières ;
- (ii) 10 % maximum de ses actifs nets peuvent être investis dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs, mais peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des Actifs « distressed » (en difficulté).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 70 % du portefeuille.

Le compartiment peut investir :

- Jusqu'à 10 % du total de ses actifs nets dans des Fonds passifs ou quantitatifs externes et/ou des ETF qui sont considérés comme relevant de l'article 6 du règlement SFDR pour lesquels l'univers d'investissement investissable est conforme à l'ensemble d'exclusions de la Société de gestion selon l'article 6 (référence au Livre 1) ;
- Jusqu'à 10 % du total de ses actifs nets dans des Fonds passifs externes et/ou des ETF qui sont considérés comme relevant de l'article 6 du règlement SFDR.

Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds sous son nom abrégé AAF Portfolio Flexible Bonds

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) à des fins d'investissement, de couverture et de gestion efficace de portefeuille ;

- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque de taux d'intérêt
- Risque de change
- Risques liés aux obligations à haut rendement
- Risque de liquidité
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|------------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU1165266542 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| Catégorie CH USD | CAP | LU1165267862 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 USD |
| | DIS | LU1670611505 | | Oui | | |
| Catégorie C | CAP | LU1165270908 | Oui | Non | | 5 000 EUR |
| | DIS | LU1670611687 | | Oui | | |
| Catégorie DH USD | CAP | LU1670611331 | Oui | Non | Investisseurs clients de Bethmann Bank et investisseurs autorisés | 5 000 USD |
| Catégorie D | CAP | LU1670611414 | Oui | Non | | 5 000 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1329512682 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neufelize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie G | DIS | LU2445655140 | Oui | Oui | Investisseurs clients de la Gestion de portefeuille discrétionnaire des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et ayant conclu un accord de commissions spécifique et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds sous son nom abrégé AAF Portfolio Flexible Bonds

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|----------------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,30% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégories C, CH USD | 0,75% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégories D, DH USD | 0,75% | - | - | 0,25 % | 0,05% |
| Catégorie F | 0,75% | - | - | 0,25 % | 0,01% |
| Catégorie G | 1,30% | - | - | 0,25 % | 0,01% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription ⁽²⁾ | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat ⁽²⁾ |
|----------------------|---|---|-------------------------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégories C, CH USD | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégories D, DH USD | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie G | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En USD pour les catégories suivantes : « Catégorie CH-USD » et « Catégorie DH-USD »

En EUR pour les catégories suivantes : « Catégorie A », « Catégorie C », « Catégorie D », « Catégorie F » et « Catégorie G »

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Ce compartiment a été lancé le 1^{er} avril 2015.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

sous son nom abrégé ABN AMRO Portfolio Flexible ESG Bonds

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de stratégies basées sur des obligations, y compris des obligations des marchés émergents et des obligations à haut rendement, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré activement en investissant dans diverses stratégies déléguées à plusieurs gestionnaires d'investissement. Le compartiment permet une allocation entre différentes stratégies de marché et zones géographiques dans l'univers des obligations. Le processus de sélection de ces gestionnaires d'investissement externes repose sur une analyse quantitative des risques et des rendements, sur une évaluation qualitative autour de cinq piliers (équipe de direction, équipe de recherche, philosophie, processus et gestion du risque) et sur la due diligence opérationnelle.

Le compartiment investit principalement (entre 0 et 100 % de ses actifs nets) et de manière discrétionnaire dans des titres de créance d'émetteurs (qui ne sont soumis à aucune contrainte en matière de notation) situés dans le monde entier, y compris dans les marchés émergents et dans des obligations à haut rendement. Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le compartiment peut également avoir recours à une variété d'instruments/stratégies, dont, entre autres, des instruments du marché monétaire, des obligations convertibles, des contrats à terme de taux, des contrats de change à terme (incluant les contrats de change à terme non livrables), des futures de taux d'intérêt, des futures d'obligations et des swaps négociés de gré à gré tels que des swaps de taux d'intérêt et des swaps de défaut de crédit.

L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment sera tenu, pour les 40 % du total de ses actifs nets restants et sur une base consolidée, de respecter toutes les limitations établies au regard des investissements en titres/instruments mentionnés ci-dessous :

- (i) 10 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des valeurs mobilières ;
- (ii) 10 % maximum de ses actifs nets peuvent être investis dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs, mais peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des Actifs « distressed » (en difficulté).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 90 % du portefeuille.

Le compartiment investira uniquement dans des fonds externes qui sont considérés comme relevant de l'article 8 ou de l'article 9 du règlement SFDR ou détenteurs d'un label de durabilité européen. Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) à des fins d'investissement, de couverture et de gestion efficace de portefeuille ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds sous son nom abrégé ABN AMRO Portfolio Flexible ESG Bonds

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque de taux d'intérêt
- Risque de change
- Risques liés aux obligations à haut rendement
- Risque de liquidité
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie G | CAP | LU2445655223 | Oui | Oui | Investisseurs clients de la Gestion de portefeuille discrétionnaire des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et ayant conclu un accord de commissions spécifique et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|-------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie G | 1,30% | - | - | 0,25 % | 0,01% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription ⁽²⁾ | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat ⁽²⁾ |
|-------------|---|---|-------------------------------------|
| Catégorie G | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds
sous son nom abrégé ABN AMRO Portfolio Flexible ESG Bonds

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En EUR pour la « Catégorie G ».

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment sera lancé à une date non encore déterminée par le Conseil d'administration.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

LIVRE II DU PROSPECTUS
—
PROFILS

ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds 1
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profile Fund Very Defensive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds Zeer Defensief

ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de catégories d'actifs variées, offrant une large distribution des risques sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré activement, en suivant une allocation stratégique et tactique entre différentes catégories d'actifs déterminée par le Comité d'investissement. Le compartiment peut être exposé à des catégories d'actifs, zones géographiques, capitalisations boursières et styles divers par l'intermédiaire de plusieurs gestionnaires d'investissement sélectionnés pour leurs compétences dans une stratégie particulière. Le processus de sélection de ces Gestionnaires d'investissement externes repose sur une analyse quantitative des risques et des rendements, sur une évaluation qualitative autour de cinq piliers (équipe de direction, équipe de recherche, philosophie, processus et gestion du risque) et sur la due diligence opérationnelle.

Le compartiment peut investir dans des obligations, des actions et des instruments du marché monétaire à travers des investissements directs, des instruments financiers dérivés ainsi que des organismes de placement collectif (y compris des fonds négociés en bourse). Outre ces catégories d'actifs, le compartiment peut être exposé aux marchés des matières premières et de l'or, avec une exposition maximale de 10 % aux organismes de placement collectif tels que les ETF et les ETC. L'accent est mis sur la diversification des investissements à l'échelle mondiale.

L'objectif est de générer un rendement à un très faible niveau de risque en gérant activement un portefeuille de valeurs mobilières.

Le gestionnaire cherchera à maintenir un profil de risque très défensif. Il privilégiera les titres porteurs d'intérêts d'échéances diverses tout en cherchant à renforcer la croissance à long terme en investissant de manière secondaire dans des actions.

Le gestionnaire répartira ses actifs nets selon l'allocation stratégique suivante :

| | |
|-----------------------------------|------|
| - Actions | 0 % |
| - Obligations | 90 % |
| - Titres de créance à court terme | 10 % |

Le gestionnaire peut dévier de l'allocation indiquée ci-dessus en faisant des choix tactiques basés sur ses anticipations de marché.

Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs, mais peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des Actifs « distressed » (en difficulté).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 90 % du portefeuille.

Le compartiment investira uniquement dans des fonds externes qui sont considérés comme relevant de l'article 8 ou de l'article 9 du règlement SFDR ou détenteurs d'un label de durabilité européen. Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures de taux d'intérêt, les futures

ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds 1
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profile Fund Very Defensive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds Zeer Defensief

d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt, les futures d'indices d'actions et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque lié à l'or et aux matières premières
- Risque de liquidité
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie R | CAP | LU0498837904 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| | DIS | LU1253566050 | Oui | Oui | | |
| Catégorie A | CAP | LU1586378801 | Oui | Non | Investisseurs clients de Banque Neufilize OBC ou de ses sociétés affiliées et investisseurs autorisés | 100 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|-------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie R | 0,45% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie A | 0,70% | - | - | 0,18% | 0,05% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie R | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée.

ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds 1
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profile Fund Very Defensive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds Zeer Defensief

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 13 mai 2010.

À compter du 1^{er} mars 2016, la « Catégorie B » a été renommée « Catégorie A-DIS ».

La « Catégorie I » a absorbé la « Catégorie I » d'Eurobonds le 11 mars 2016.

À compter du 26 février 2023, les catégories « Catégorie A-CAP » et « Catégorie A-DIS » ont été renommées « Catégorie R-CAP » et « Catégorie R-DIS ».

À compter du 26 février 2023, la « Catégorie A2-CAP » a été renommée « Catégorie A-CAP ».

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds 2
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profile Fund Defensive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds Defensief

ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de catégories d'actifs variées, offrant une large distribution des risques sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré activement, en suivant une allocation stratégique et tactique entre différentes catégories d'actifs déterminée par le Comité d'investissement. Le compartiment peut être exposé à des catégories d'actifs, zones géographiques, capitalisations boursières et styles divers par l'intermédiaire de plusieurs gestionnaires d'investissement sélectionnés pour leurs compétences dans une stratégie particulière. Le processus de sélection de ces Gestionnaires d'investissement externes repose sur une analyse quantitative des risques et des rendements, sur une évaluation qualitative autour de cinq piliers (équipe de direction, équipe de recherche, philosophie, processus et gestion du risque) et sur la due diligence opérationnelle.

Le compartiment peut investir dans des obligations, des actions et des instruments du marché monétaire à travers des investissements directs, des instruments financiers dérivés ainsi que des organismes de placement collectif (y compris des fonds négociés en bourse). Outre ces catégories d'actifs, le compartiment peut être exposé aux marchés des matières premières et de l'or, avec une exposition maximale de 10 % aux organismes de placement collectif tels que les ETF et les ETC. L'accent est mis sur la diversification des investissements à l'échelle mondiale.

L'objectif est de générer un rendement à un niveau de risque faible en gérant activement un portefeuille de valeurs mobilières.

Le gestionnaire cherchera à maintenir un profil de risque défensif. Il privilégiera les titres porteurs d'intérêts d'échéances diverses tout en cherchant à renforcer la croissance à long terme en investissant de manière secondaire dans des actions. Les investissements sur les marchés émergents sont limités à 20 %.

Le gestionnaire répartira ses actifs nets selon l'allocation stratégique suivante :

| | |
|-----------------------------------|------|
| - Actions | 20 % |
| - Obligations | 70 % |
| - Titres de créance à court terme | 10 % |

Le gestionnaire peut dévier de l'allocation indiquée ci-dessus en faisant des choix tactiques basés sur ses anticipations de marché.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % de son actif net dans des actions chinoises (Actions A), libellées en CNH, qui sont cotées sur la Bourse de Hong Kong via le Shanghai-Hong Kong et Shenzhen Stock Connect.

Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs, mais peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des Actifs « distressed » (en difficulté).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 90 % du portefeuille.

Le compartiment investira uniquement dans des fonds externes qui sont considérés comme relevant de l'article 8 ou de l'article 9 du règlement SFDR ou détenteurs d'un label de durabilité européen. Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds 2
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profile Fund Defensive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds Defensief

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt, les futures d'indices d'actions et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque lié à l'or et aux matières premières
- Risque de liquidité
- Risques spécifiques liés aux investissements en Chine
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|------------------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie R | CAP | LU0121970122 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| ABN AMRO Profiefonds A | DIS | LU1253566217 | Oui | Oui | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| Catégorie A | CAP | LU1586379015 | Oui | Non | Investisseurs clients de Banque Neulize OBC ou de ses sociétés affiliées et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| Catégorie F | CAP | LU1586379106 | Oui | Non | Investisseurs clients du Portefeuille de gestion discrétionnaire de Banque Neulize OBC et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU1253566308 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |
| Catégorie IH USD | CAP | LU1955040164 | Oui | Non | | 1 000 000 USD |

⁽¹⁾ Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds 2
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profile Fund Defensive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds Defensief

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|------------------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie R | 0,60% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| ABN AMRO Profiefonds A | 1,00% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie A | 1,00% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie F | 0,60% | - | - | 0,18% | 0,01% |
| Catégories I, IH USD | 0,50% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|------------------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie R | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| ABN AMRO Profiefonds A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie F | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégories I, IH USD | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

En EUR pour les catégories suivantes : « Catégorie A », « Catégorie ABN AMRO Profiefonds A », « Catégorie A2 », « Catégorie F » et « Catégorie I ».

En USD pour la catégorie suivante : « Catégorie IH USD ».

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 11 juin 2001 sous la dénomination « Defensive Profile ».

Le 17 mai 2010, le compartiment a remplacé son ancien nom « Defensive Profile » par « Profile 2 ».

À compter du 26 février 2023, la « Catégorie A-CAP » a été renommée « Catégorie R-CAP ».

À compter du 26 février 2023, la « Catégorie A2-CAP » a été renommée « Catégorie A-CAP ».

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds 3
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profile Fund Moderately Defensive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds Matig Defensief

ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de catégories d'actifs variées, offrant une large distribution des risques sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré activement, en suivant une allocation stratégique et tactique entre différentes catégories d'actifs déterminée par le Comité d'investissement. Le compartiment peut être exposé à des catégories d'actifs, zones géographiques, capitalisations boursières et styles divers par l'intermédiaire de plusieurs gestionnaires d'investissement sélectionnés pour leurs compétences dans une stratégie particulière. Le processus de sélection de ces Gestionnaires d'investissement externes repose sur une analyse quantitative des risques et des rendements, sur une évaluation qualitative autour de cinq piliers (équipe de direction, équipe de recherche, philosophie, processus et gestion du risque) et sur la due diligence opérationnelle.

Le compartiment peut investir dans des obligations, des actions et des instruments du marché monétaire à travers des investissements directs, des instruments financiers dérivés ainsi que des organismes de placement collectif (y compris des fonds négociés en bourse). Outre ces catégories d'actifs, le compartiment peut être exposé aux marchés des matières premières et de l'or, avec une exposition maximale de 10 % aux organismes de placement collectif tels que les ETF et les ETC. L'accent est mis sur la diversification des investissements à l'échelle mondiale.

L'objectif est de générer des rendements à un niveau de risque modérément faible en gérant activement un portefeuille de valeurs mobilières.

Le gestionnaire cherchera à maintenir un profil de risque modéré. Il privilégiera les titres porteurs d'intérêts d'échéances diverses et les actions tout en donnant la préférence aux premiers cités. Les investissements sur les marchés émergents sont limités à 20 %.

Le gestionnaire répartira ses actifs nets selon l'allocation stratégique suivante :

| | |
|-----------------------------------|------|
| - Actions | 35 % |
| - Obligations | 55 % |
| - Titres de créance à court terme | 10 % |

Le gestionnaire peut dévier de l'allocation indiquée ci-dessus en faisant des choix tactiques basés sur ses anticipations de marché.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % de son actif net dans des actions chinoises (Actions A), libellées en CNH, qui sont cotées sur la Bourse de Hong Kong via le Shanghai-Hong Kong et Shenzhen Stock Connect.

Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs, mais peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des Actifs « distressed » (en difficulté).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 90 % du portefeuille.

Le compartiment investira uniquement dans des fonds externes qui sont considérés comme relevant de l'article 8 ou de l'article 9 du règlement SFDR ou détenteurs d'un label de durabilité européen. Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds 3
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profile Fund Moderately Defensive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds Matig Defensief

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt, les futures d'indices d'actions et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque lié à l'or et aux matières premières
- Risque de liquidité
- Risques spécifiques liés aux investissements en Chine
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|----------------------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie R | CAP | LU0498838035 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| | DIS | LU1253566480 | Oui | Oui | | |
| ABN AMRO Wealth Allocation | CAP | LU2281297122 | Oui | Non | | |
| Catégorie A | CAP | LU1586379288 | Oui | Non | Investisseurs clients de Banque Neuflyze OBC ou de ses sociétés affiliées et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU1253566563 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|----------------------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie R | 0,75% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| ABN AMRO Wealth Allocation | 1,30% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie A | 1,30% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie I | 0,65% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds 3
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profile Fund Moderately Defensive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds Matig Defensief

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|----------------------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie R | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| ABN AMRO Wealth Allocation | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 13 mai 2010.

Au 1^{er} mars 2016, la « Catégorie B » a été renommée « Catégorie A-DIS ».

À compter du 26 février 2023, les catégories « Catégorie A-CAP » et « Catégorie A-DIS » ont été renommées « Catégorie R-CAP » et « Catégorie R-DIS ».

À compter du 26 février 2023, la « Catégorie A2-CAP » a été renommée « Catégorie A-CAP ».

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds 4
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profile Fund Moderately Aggressive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds Matig Offensief

ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de catégories d'actifs variées, offrant une large distribution des risques sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré activement, en suivant une allocation stratégique et tactique entre différentes catégories d'actifs déterminée par le Comité d'investissement. Le compartiment peut être exposé à des catégories d'actifs, zones géographiques, capitalisations boursières et styles divers par l'intermédiaire de plusieurs gestionnaires d'investissement sélectionnés pour leurs compétences dans une stratégie particulière. Le processus de sélection de ces Gestionnaires d'investissement externes repose sur une analyse quantitative des risques et des rendements, sur une évaluation qualitative autour de cinq piliers (équipe de direction, équipe de recherche, philosophie, processus et gestion du risque) et sur la due diligence opérationnelle.

Le compartiment peut investir dans des obligations, des actions et des instruments du marché monétaire à travers des investissements directs, des instruments financiers dérivés ainsi que des organismes de placement collectif (y compris des fonds négociés en bourse). Outre ces catégories d'actifs, le compartiment peut être exposé aux marchés des matières premières et de l'or, avec une exposition maximale de 10 % aux organismes de placement collectif tels que les ETF et les ETC. L'accent est mis sur la diversification des investissements à l'échelle mondiale.

L'objectif est de générer des rendements à un niveau de risque modérément élevé en gérant activement un portefeuille de valeurs mobilières.

Le gestionnaire s'efforcera de maintenir un profil de risque intermédiaire. Il investira dans des titres porteurs d'intérêts d'échéances diverses ainsi que dans des actions et privilégiera généralement ces dernières. Les investissements sur les marchés émergents sont limités à 20 %.

Le gestionnaire répartira ses actifs nets selon l'allocation stratégique suivante :

| | |
|-----------------------------------|------|
| - Actions | 55 % |
| - Obligations | 35 % |
| - Titres de créance à court terme | 10 % |

Le gestionnaire peut dévier de l'allocation indiquée ci-dessus en faisant des choix tactiques basés sur ses anticipations de marché. De plus, le compartiment investira un minimum de 25 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % de son actif net dans des actions chinoises (Actions A), libellées en CNH, qui sont cotées sur la Bourse de Hong Kong via le Shanghai-Hong Kong et Shenzhen Stock Connect.

Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs, mais peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des Actifs « distressed » (en difficulté).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 90 % du portefeuille.

Le compartiment investira uniquement dans des fonds externes qui sont considérés comme relevant de l'article 8 ou de l'article 9 du règlement SFDR ou détenteurs d'un label de durabilité européen. Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds 4
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profile Fund Moderately Aggressive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds Matig Offensief

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt, les futures d'indices d'actions et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque lié à l'or et aux matières premières
- Risque de liquidité
- Risques spécifiques liés aux investissements en Chine
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|------------------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie R | CAP | LU0121970809 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| ABN AMRO Profiefonds B | DIS | LU1253566647 | Oui | Oui | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| Catégorie A | CAP | LU1586379445 | Oui | Non | Investisseurs clients de Banque Neulize OBC ou de ses sociétés affiliées et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU1253566720 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |
| Catégorie M | CAP | LU2570258538 | Oui | Non | Investisseurs étant des entités nourricières des compartiments de la Société et investisseurs autorisés | 20 000 000 EUR 20 000 000 USD |

⁽¹⁾ Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds 4
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profile Fund Moderately Aggressive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds Matig Offensief

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|------------------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie R | 0,80% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| ABN AMRO Profiefonds B | 1,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie A | 1,40% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie I | 0,70% | - | - | 0,15% | 0,01% |
| Catégorie M | 0,70% | - | - | 0,18% | 0,01% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|------------------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie R | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| ABN AMRO Profiefonds B | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |
| Catégorie M | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé sous la dénomination « Diversified Profile ».

Le 17 mai 2010, le compartiment a remplacé son ancien nom « Diversified Profile » par « Profile 4 ».

À compter du 26 février 2023, la « Catégorie A-CAP » a été renommée « Catégorie R-CAP ».

À compter du 26 février 2023, la « Catégorie A2-CAP » a été renommée « Catégorie A-CAP ».

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds 5
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profile Fund Aggressive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds Offensief

ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de catégories d'actifs variées, offrant une large distribution des risques sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré activement, en suivant une allocation stratégique et tactique entre différentes catégories d'actifs déterminée par le Comité d'investissement. Le compartiment peut être exposé à des catégories d'actifs, zones géographiques, capitalisations boursières et styles divers par l'intermédiaire de plusieurs gestionnaires d'investissement sélectionnés pour leurs compétences dans une stratégie particulière. Le processus de sélection de ces Gestionnaires d'investissement externes repose sur une analyse quantitative des risques et des rendements, sur une évaluation qualitative autour de cinq piliers (équipe de direction, équipe de recherche, philosophie, processus et gestion du risque) et sur la due diligence opérationnelle.

Le compartiment peut investir dans des obligations, des actions et des instruments du marché monétaire à travers des investissements directs, des instruments financiers dérivés ainsi que des organismes de placement collectif (y compris des fonds négociés en bourse). Outre ces catégories d'actifs, le compartiment peut être exposé aux marchés des matières premières et de l'or, avec une exposition maximale de 10 % aux organismes de placement collectif tels que les ETF et les ETC. L'accent est mis sur la diversification des investissements à l'échelle mondiale.

L'objectif est de tirer profit des opportunités d'investissement permettant de créer de la valeur, tout en limitant les risques et en gérant activement un portefeuille de valeurs mobilières.

Le gestionnaire cherchera à maintenir un profil de risque élevé. Il privilégiera les actions tout en gérant le risque en investissant, de manière secondaire, dans des titres porteurs d'intérêts d'échéances diverses. Les investissements sur les marchés émergents sont limités à 20 %.

Le gestionnaire répartira ses actifs nets selon l'allocation stratégique suivante :

| | |
|-----------------------------------|------|
| - Actions | 75 % |
| - Obligations | 15 % |
| - Titres de créance à court terme | 10 % |

Le gestionnaire peut dévier de l'allocation indiquée ci-dessus en faisant des choix tactiques basés sur ses anticipations de marché. De plus, le compartiment investira un minimum de 25 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % de son actif net dans des actions chinoises (Actions A), libellées en CNH, qui sont cotées sur la Bourse de Hong Kong via le Shanghai-Hong Kong et Shenzhen Stock Connect.

Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs, mais peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des Actifs « distressed » (en difficulté).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 90 % du portefeuille.

Le compartiment investira uniquement dans des fonds externes qui sont considérés comme relevant de l'article 8 ou de l'article 9 du règlement SFDR ou détenteurs d'un label de durabilité européen. Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds 5
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profile Fund Aggressive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds Offensief

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt, les futures d'indices d'actions et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque lié à l'or et aux matières premières
- Risque de liquidité
- Risques spécifiques liés aux investissements en Chine
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---|---------------------------------------|
| Catégorie R | CAP | LU0498838118 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| | DIS | LU1253566993 | Oui | Oui | | 100 EUR |
| Catégorie A | CAP | LU1586379791 | Oui | Non | Investisseurs clients de Banque Neulize OBC ou de ses sociétés affiliées et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU1253567025 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|-------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie R | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie A | 1,50% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie I | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds 5
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profile Fund Aggressive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds Offensief

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie R | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 13 mai 2010.

Au 1^{er} mars 2016, la « Catégorie B » a été renommée « Catégorie A-DIS ».

À compter du 26 février 2023, les catégories « Catégorie A-CAP » et « Catégorie A-DIS » ont été renommées « Catégorie R-CAP » et « Catégorie R-DIS ».

À compter du 26 février 2023, la « Catégorie A2-CAP » a été renommée « Catégorie A-CAP ».

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds 6
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profile Fund Very Aggressive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds Zeer Offensief

ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de catégories d'actifs variées, offrant une large distribution des risques sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment est géré activement, en suivant une allocation stratégique et tactique entre différentes catégories d'actifs déterminée par le Comité d'investissement. Le compartiment peut être exposé à des catégories d'actifs, zones géographiques, capitalisations boursières et styles divers par l'intermédiaire de plusieurs gestionnaires d'investissement sélectionnés pour leurs compétences dans une stratégie particulière. Le processus de sélection de ces Gestionnaires d'investissement externes repose sur une analyse quantitative des risques et des rendements, sur une évaluation qualitative autour de cinq piliers (équipe de direction, équipe de recherche, philosophie, processus et gestion du risque) et sur la due diligence opérationnelle.

Le compartiment peut investir dans des obligations, des actions et des instruments du marché monétaire à travers des investissements directs, des instruments financiers dérivés ainsi que des organismes de placement collectif (y compris des fonds négociés en bourse). Outre ces catégories d'actifs, le compartiment peut être exposé aux marchés des matières premières et de l'or, avec une exposition maximale de 10 % aux organismes de placement collectif tels que les ETF et les ETC. L'accent est mis sur la diversification des investissements à l'échelle mondiale.

L'objectif est de tirer profit des opportunités d'investissement permettant de créer de la valeur en gérant activement un portefeuille de valeurs mobilières.

Le gestionnaire cherchera à maintenir un profil de risque agressif. Il privilégiera les actions tout en gérant le risque en investissant, de manière secondaire, dans des titres porteurs d'intérêts d'échéances diverses. Les investissements sur les marchés émergents sont limités à 20 %.

Le gestionnaire répartira ses actifs nets selon l'allocation stratégique suivante :

| | |
|-----------------------------------|------|
| - Actions | 90 % |
| - Obligations | 0 % |
| - Titres de créance à court terme | 10 % |

Le gestionnaire peut dévier de l'allocation indiquée ci-dessus en faisant des choix tactiques basés sur ses anticipations de marché. De plus, le compartiment investira un minimum de 51 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % de son actif net dans des actions chinoises (Actions A), libellées en CNH, qui sont cotées sur la Bourse de Hong Kong via le Shanghai-Hong Kong et Shenzhen Stock Connect.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 90 % du portefeuille.

Le compartiment investira uniquement dans des fonds externes qui sont considérés comme relevant de l'article 8 ou de l'article 9 du règlement SFDR ou détenteurs d'un label de durabilité européen. Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures d'indices d'action et les futures de change) ;

ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds 6
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profile Fund Very Aggressive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds Zeer Offensief

- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque lié à l'or et aux matières premières
- Risques spécifiques liés aux investissements en Chine
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|------------------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie R | CAP | LU0121971286 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| ABN AMRO Profiefonds C | DIS | LU1253567298 | Oui | Oui | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| Catégorie A | CAP | LU1586379957 | Oui | Non | Investisseurs clients de Banque Neufilize OBC ou de ses sociétés affiliées et investisseurs autorisés | 100 EUR |
| Catégorie I | CAP | LU0159601755 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|------------------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie R | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| ABN AMRO Profiefonds C | 1,50% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie A | 1,50% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie I | 0,75% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds 6
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profile Fund Very Aggressive
sous son nom abrégé ABN AMRO ESG Profiefonds Zeer Offensief

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|------------------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie R | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| ABN AMRO Profiefonds C | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 11 juin 2001 sous la dénomination « Dynamic Profile ».

Le 17 mai 2010, le compartiment a remplacé son ancien nom « Dynamic Profile » par « Profile 6 ».

À compter du 26 février 2023, la « Catégorie A-CAP » a été renommée « Catégorie R-CAP ».

À compter du 26 février 2023, la « Catégorie A2-CAP » a été renommée « Catégorie A-CAP ».

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Comfort Invest II **sous son nom abrégé ABN AMRO Comfort Invest II**

ABN AMRO Funds Comfort Invest II

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de catégories d'actifs variées, offrant une large distribution des risques sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment peut investir dans des obligations, des actions et des instruments du marché monétaire à travers des investissements directs, des instruments financiers dérivés ainsi que des organismes de placement collectif (y compris des fonds négociés en bourse). L'accent est mis sur la diversification des investissements à l'échelle mondiale.

L'objectif est de générer un rendement à un niveau de risque faible en gérant activement un portefeuille de valeurs mobilières.

Le gestionnaire cherchera à maintenir un profil de risque défensif. Il privilégiera les titres porteurs d'intérêts d'échéances diverses tout en cherchant à renforcer la croissance à long terme en investissant de manière secondaire dans des actions. Les investissements sur les marchés émergents sont limités à 20 %.

Le gestionnaire répartira ses actifs nets selon l'allocation stratégique suivante :

- Actions 20 %
- Obligations 70 %
- Titres de créance à court terme 10 %

Le gestionnaire peut dévier de l'allocation indiquée ci-dessus en faisant des choix tactiques basés sur ses anticipations de marché.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt, les futures d'indices d'actions et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement

ABN AMRO Investment Solutions

Conseiller externe

ABN AMRO Bank N.V. Succursale belge

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

ABN AMRO Funds Comfort Invest II sous son nom abrégé ABN AMRO Comfort Invest II

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie A | DIS | LU1332699161 | Oui | Oui | Tous | 100 EUR |
| Catégorie B | DIS | LU1332699245 | Oui | Oui | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | DIS | LU2281297395 | Oui | Oui | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|-------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,25% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie B | 0,95% | - | - | 0,18 % | 0,05% |
| Catégorie I | 0,65% | - | - | 0,18% | 0,01% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie B | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|--|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Trois jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+3) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Ce compartiment a été lancé le 19 mai 2016.

| |
|--|
| <p style="text-align: center;">ABN AMRO Funds Comfort Invest II sous son nom abrégé ABN AMRO Comfort Invest II</p> |
|--|

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

Dividendes :

Sans porter atteinte aux droits et obligations établis lors de l'Assemblée générale des actionnaires, comme prévu par les dispositions de la Loi du 10 août 1915 et des Statuts, la Société décidera de distribuer aux détenteurs d'actions de distribution, la somme des revenus obtenus, après déduction des rémunérations, commissions et charges correspondantes de façon proportionnelle. Pour les catégories distribuées en Belgique et conformément au Code belge des impôts sur les revenus, le revenu distribué s'entend au moins comme le revenu qui provient, directement ou indirectement, sous la forme d'intérêts et de plus-values (réalisées et latentes) (déduction faite des moins-values), des actifs investis dans des créances au sens de l'article 19bis §1, (5) du Code belge des impôts sur les revenus après déduction des rémunérations, commissions et coûts (le Taxable Income Per Share ou « TIS » annuel belge).

ABN AMRO Funds Comfort Invest III

sous son nom abrégé ABN AMRO Comfort Invest III

ABN AMRO Funds Comfort Invest III

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de catégories d'actifs variées, offrant une large distribution des risques sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment peut investir dans des obligations, des actions et des instruments du marché monétaire à travers des investissements directs, des instruments financiers dérivés ainsi que des organismes de placement collectif (y compris des fonds négociés en bourse). L'accent est mis sur la diversification des investissements à l'échelle mondiale.

L'objectif est de générer des rendements à un niveau de risque modérément faible en gérant activement un portefeuille de valeurs mobilières.

Le gestionnaire cherchera à maintenir un profil de risque modéré. Il privilégiera les titres porteurs d'intérêts d'échéances diverses et les actions tout en donnant la préférence aux premiers cités. Les investissements sur les marchés émergents sont limités à 20 %.

Le gestionnaire répartira ses actifs nets selon l'allocation stratégique suivante :

| | |
|---------------------------------|------|
| Actions | 35 % |
| Obligations | 55 % |
| Titres de créance à court terme | 10 % |

Le gestionnaire peut dévier de l'allocation indiquée ci-dessus en faisant des choix tactiques basés sur ses anticipations de marché.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt, les futures d'indices d'actions et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement

ABN AMRO Investment Solutions

Conseiller externe

ABN AMRO Bank N.V. Succursale belge

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

ABN AMRO Funds Comfort Invest III
sous son nom abrégé ABN AMRO Comfort Invest III

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Montant minimum de participation ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---|
| Catégorie A | DIS | LU1332699591 | Oui | Oui | Tous | 100 EUR |
| Catégorie B | DIS | LU1332699674 | Oui | Oui | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | DIS | LU2281297478 | Oui | Oui | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|-------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,25% | - | - | 0,18 % | 0,05 % |
| Catégorie B | 0,95% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie I | 0,65% | - | - | 0,18% | 0,01% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00 % | 1,00 % |
| Catégorie B | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|--|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Trois jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+3) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Ce compartiment a été lancé le 19 mai 2016 pour la « Catégorie B-EUR »

| |
|--|
| <p style="text-align: center;">ABN AMRO Funds Comfort Invest III sous son nom abrégé ABN AMRO Comfort Invest III</p> |
|--|

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

Dividendes :

Sans porter atteinte aux droits et obligations établis lors de l'Assemblée générale des actionnaires, comme prévu par les dispositions de la Loi du 10 août 1915 et des Statuts, la Société décidera de distribuer aux détenteurs d'actions de distribution, la somme des revenus obtenus, après déduction des rémunérations, commissions et charges correspondantes de façon proportionnelle.

Pour les catégories distribuées en Belgique et conformément au Code belge des impôts sur les revenus, le revenu distribué s'entend au moins comme le revenu qui provient, directement ou indirectement, sous la forme d'intérêts et de plus-values (réalisées et latentes) (déduction faite des moins-values), des actifs investis dans des créances au sens de l'article 19bis §1, (5) du Code belge des impôts sur les revenus après déduction des rémunérations, commissions et coûts (le Taxable Income Per Share ou « TIS » annuel belge).

ABN AMRO Funds Comfort Invest IV

sous son nom abrégé ABN AMRO Comfort Invest IV

ABN AMRO Funds Comfort Invest IV

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de catégories d'actifs variées, offrant une large distribution des risques sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment peut investir dans des obligations, des actions et des instruments du marché monétaire à travers des investissements directs, des instruments financiers dérivés ainsi que des organismes de placement collectif (y compris des fonds négociés en bourse). L'accent est mis sur la diversification des investissements à l'échelle mondiale.

L'objectif est de générer des rendements à un niveau de risque modérément élevé en gérant activement un portefeuille de valeurs mobilières.

Le gestionnaire s'efforcera de maintenir un profil de risque intermédiaire. Il investira dans des titres porteurs d'intérêts d'échéances diverses ainsi que dans des actions et privilégiera généralement ces dernières. Les investissements sur les marchés émergents sont limités à 20 %.

Le gestionnaire répartira ses actifs nets selon l'allocation stratégique suivante :

- Actions 55 %
- Obligations 35 %
- Titres de créance à court terme 10 %

Le gestionnaire peut dévier de l'allocation indiquée ci-dessus en faisant des choix tactiques basés sur ses anticipations de marché.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt, les futures d'indices d'actions et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement

ABN AMRO Investment Solutions

Conseiller externe

ABN AMRO Bank N.V. Succursale belge

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

ABN AMRO Funds Comfort Invest IV
sous son nom abrégé ABN AMRO Comfort Invest IV

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Montant minimum de participation ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---|
| Catégorie A | DIS | LU1332699831 | Oui | Oui | Tous | 100 EUR |
| Catégorie B | DIS | LU1332699914 | Oui | Oui | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| Catégorie I | DIS | LU2281297551 | Oui | Oui | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|-------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,25% | - | - | 0,18 % | 0,05 % |
| Catégorie B | 0,95% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie I | 0,65% | - | - | 0,18% | 0,01% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00 % | 1,00 % |
| Catégorie B | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|--|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Trois jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+3) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

| |
|--|
| <p style="text-align: center;">ABN AMRO Funds Comfort Invest IV sous son nom abrégé ABN AMRO Comfort Invest IV</p> |
|--|

Données historiques :

Ce compartiment a été lancé le 19 mai 2016 pour la « Catégorie B-EUR »

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

Dividendes :

Sans porter atteinte aux droits et obligations établis lors de l'Assemblée générale des actionnaires, comme prévu par les dispositions de la Loi du 10 août 1915 et des Statuts, la Société décidera de distribuer aux détenteurs d'actions de distribution, la somme des revenus obtenus, après déduction des rémunérations, commissions et charges correspondantes de façon proportionnelle.

Pour les catégories distribuées en Belgique et conformément au Code belge des impôts sur les revenus, le revenu distribué s'entend au moins comme le revenu qui provient, directement ou indirectement, sous la forme d'intérêts et de plus-values (réalisées et latentes) (déduction faite des moins-values), des actifs investis dans des créances au sens de l'article 19bis §1, (5) du Code belge des impôts sur les revenus après déduction des rémunérations, commissions et coûts (le Taxable Income Per Share ou « TIS » annuel belge).

ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Defensief **sous son nom abrégé ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Defensief** **ou AAV Beleggingsfonds Zeer Defensief**

ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Defensief

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de catégories d'actifs variées, offrant une large distribution des risques sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment peut investir dans des obligations, des actions et des instruments du marché monétaire à travers des investissements directs, des instruments financiers dérivés ainsi que des organismes de placement collectif (y compris des fonds négociés en bourse). Outre ces types d'actifs, le compartiment peut être exposé aux matières premières avec une exposition maximale de 10 % aux organismes de placement collectif tels que des ETF et des ETC. L'accent est mis sur la diversification des investissements à l'échelle mondiale.

L'objectif est de générer un rendement à un très faible niveau de risque en gérant activement un portefeuille de valeurs mobilières.

Le gestionnaire cherchera à maintenir un profil de risque très défensif. Il privilégiera les titres porteurs d'intérêts d'échéances diverses tout en cherchant à renforcer la croissance à long terme en investissant de manière secondaire dans des actions.

Le gestionnaire répartira ses actifs nets selon l'allocation stratégique suivante :

- Actions : 0 %
- Obligations : 90%
- Titres de créance à court terme : 10%

Le gestionnaire peut dévier de l'allocation indiquée ci-dessus en faisant des choix tactiques basés sur ses anticipations de marché.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

En vertu des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance de ManCo et conformément aux Principes pour l'investissement responsable des Nations Unies, le compartiment exclut tout investissement direct dans des titres émis par des sociétés impliquées dans des activités hautement controversées (telles que la production de tabac et d'armes controversées) et/ou en violation grave des principes du Pacte mondial des Nations Unies.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque lié aux matières premières

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Defensief
sous son nom abrégé ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Defensief
ou AAV Beleggingsfonds Zeer Defensief

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---------------|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU0752954569 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|-------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 0,75% | - | - | 0,18% | 0,05% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription ⁽²⁾ | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat ⁽²⁾ |
|-------------|---|---|-------------------------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Ce compartiment a été lancé le 12 mars 2012.

Le 29 juillet 2014 : le compartiment a changé de catégorie de compartiments, passant de la catégorie « Fonds de fonds » à la catégorie « Profil ».

L'ancien nom était « Verzekeringen Profile 1 ».

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Defensief **sous son nom abrégé ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Defensief** **ou AAV Beleggingsfonds Defensief**

ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Defensief

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de catégories d'actifs variées, offrant une large distribution des risques sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment peut investir dans des obligations, des actions et des instruments du marché monétaire à travers des investissements directs, des instruments financiers dérivés ainsi que des organismes de placement collectif (y compris des fonds négociés en bourse). Outre ces types d'actifs, le compartiment peut être exposé aux matières premières avec une exposition maximale de 10 % aux organismes de placement collectif tels que des ETF et des ETC. L'accent est mis sur la diversification des investissements à l'échelle mondiale.

L'objectif est de générer un rendement à un niveau de risque faible en gérant activement un portefeuille de valeurs mobilières.

Le gestionnaire cherchera à maintenir un profil de risque défensif. Il privilégiera les titres porteurs d'intérêts d'échéances diverses tout en cherchant à renforcer la croissance à long terme en investissant de manière secondaire dans des actions. Les investissements sur les marchés émergents sont limités à 20 %.

Le gestionnaire répartira ses actifs nets selon l'allocation stratégique suivante :

- Actions : 20 %
- Obligations : 70%
- Titres de créance à court terme : 10%

Le gestionnaire peut dévier de l'allocation indiquée ci-dessus en faisant des choix tactiques basés sur ses anticipations de marché.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

En vertu des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance de ManCo et conformément aux Principes pour l'investissement responsable des Nations Unies, le compartiment exclut tout investissement direct dans des titres émis par des sociétés impliquées dans des activités hautement controversées (telles que la production de tabac et d'armes controversées) et/ou en violation grave des principes du Pacte mondial des Nations Unies.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt, les futures d'indices d'actions et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque lié aux matières premières

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Defensief
sous son nom abrégé ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Defensief
ou AAV Beleggingsfonds Defensief

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---------------|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU0752954643 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|-------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 0,75% | - | - | 0,18% | 0,05% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription ⁽²⁾ | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat ⁽²⁾ |
|-------------|---|---|-------------------------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée.

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Ce compartiment a été lancé le 12 mars 2012.

Le 29 juillet 2014 : le compartiment a changé de catégorie de compartiments, passant de la catégorie « Fonds de fonds » à la catégorie « Profil ».

L'ancien nom était « Verzekeringen Profile 2 ».

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Defensief **sous son nom abrégé ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Defensief** **ou AAV Beleggingsfonds Matig Defensief**

ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Defensief

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de catégories d'actifs variées, offrant une large distribution des risques sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment peut investir dans des obligations, des actions et des instruments du marché monétaire à travers des investissements directs, des instruments financiers dérivés ainsi que des organismes de placement collectif (y compris des fonds négociés en bourse). Outre ces types d'actifs, le compartiment peut être exposé aux matières premières avec une exposition maximale de 10 % aux organismes de placement collectif tels que des ETF et des ETC. L'accent est mis sur la diversification des investissements à l'échelle mondiale.

L'objectif est de générer des rendements à un niveau de risque modérément faible en gérant activement un portefeuille de valeurs mobilières.

Le gestionnaire cherchera à maintenir un profil de risque modéré. Il privilégiera les titres porteurs d'intérêts d'échéances diverses et les actions tout en donnant la préférence aux premiers cités. Les investissements sur les marchés émergents sont limités à 20 %.

Le gestionnaire répartira ses actifs nets selon l'allocation stratégique suivante :

- Actions : 35 %
- Obligations : 55%
- Titres de créance à court terme : 10%

Le gestionnaire peut dévier de l'allocation indiquée ci-dessus en faisant des choix tactiques basés sur ses anticipations de marché.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

En vertu des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance de ManCo et conformément aux Principes pour l'investissement responsable des Nations Unies, le compartiment exclut tout investissement direct dans des titres émis par des sociétés impliquées dans des activités hautement controversées (telles que la production de tabac et d'armes controversées) et/ou en violation grave des principes du Pacte mondial des Nations Unies.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt, les futures d'indices d'actions et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque lié aux matières premières

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

**ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Defensief
sous son nom abrégé ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Defensief
ou AAV Beleggingsfonds Matig Defensief**

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---------------|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU0752954726 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|-------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 0,75% | - | - | 0,18% | 0,05% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription ⁽²⁾ | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat ⁽²⁾ |
|-------------|---|---|-------------------------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Ce compartiment a été lancé le 12 mars 2012.

Le 29 juillet 2014 : le compartiment a changé de catégorie de compartiments, passant de la catégorie « Fonds de fonds » à la catégorie « Profil ».

L'ancien nom était « Verzekeringen Profile 3 ».

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Offensief sous son nom abrégé ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Offensief ou AAV Beleggingsfonds Matig Offensief

ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Offensief

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de catégories d'actifs variées, offrant une large distribution des risques sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment peut investir dans des obligations, des actions et des instruments du marché monétaire à travers des investissements directs, des instruments financiers dérivés ainsi que des organismes de placement collectif (y compris des fonds négociés en bourse) et, à titre accessoire, dans des actifs liquides. Outre ces types d'actifs, le compartiment peut être exposé aux matières premières avec une exposition maximale de 10 % aux organismes de placement collectif tels que des ETF et des ETC. L'accent est mis sur la diversification des investissements à l'échelle mondiale.

L'objectif est de générer des rendements à un niveau de risque modérément élevé en gérant activement un portefeuille de valeurs mobilières.

Le gestionnaire s'efforcera de maintenir un profil de risque intermédiaire. Il investira dans des titres porteurs d'intérêts d'échéances diverses ainsi que dans des actions et privilégiera généralement ces dernières. Les investissements sur les marchés émergents sont limités à 20 %.

Le gestionnaire répartira ses actifs nets selon l'allocation stratégique suivante :

- Actions : 55 %
- Obligations : 35%
- Titres de créance à court terme : 10%

Le gestionnaire peut dévier de l'allocation indiquée ci-dessus en faisant des choix tactiques basés sur ses anticipations de marché.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

En vertu des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance de ManCo et conformément aux Principes pour l'investissement responsable des Nations Unies, le compartiment exclut tout investissement direct dans des titres émis par des sociétés impliquées dans des activités hautement controversées (telles que la production de tabac et d'armes controversées) et/ou en violation grave des principes du Pacte mondial des Nations Unies.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt, les futures d'indices d'actions et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque lié aux matières premières

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Offensief
sous son nom abrégé ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Offensief
ou AAV Beleggingsfonds Matig Offensief

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---------------|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU0752954999 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|-------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 0,75% | - | - | 0,18% | 0,05% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription ⁽²⁾ | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat ⁽²⁾ |
|-------------|---|---|-------------------------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Ce compartiment a été lancé le 12 mars 2012.

Le 29 juillet 2014 : le compartiment a changé de catégorie de compartiments, passant de la catégorie « Fonds de fonds » à la catégorie « Profil ».

L'ancien nom était « Verzekeringen Profile 4 ».

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Offensief **sous son nom abrégé ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Offensief** **ou AAV Beleggingsfonds Offensief**

ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Offensief

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de catégories d'actifs variées, offrant une large distribution des risques sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment peut investir dans des obligations, des actions et des instruments du marché monétaire à travers des investissements directs, des instruments financiers dérivés ainsi que des organismes de placement collectif (y compris des fonds négociés en bourse). Outre ces types d'actifs, le compartiment peut être exposé aux matières premières avec une exposition maximale de 10 % aux organismes de placement collectif tels que des ETF et des ETC. L'accent est mis sur la diversification des investissements à l'échelle mondiale.

L'objectif est de tirer profit des opportunités d'investissement permettant de créer de la valeur, tout en limitant les risques et en gérant activement un portefeuille de valeurs mobilières.

Le gestionnaire cherchera à maintenir un profil de risque élevé. Il privilégiera les actions tout en gérant le risque en investissant, de manière secondaire, dans des titres porteurs d'intérêts d'échéances diverses. Les investissements sur les marchés émergents sont limités à 20 %.

Le gestionnaire répartira ses actifs nets selon l'allocation stratégique suivante :

- Actions : 75 %
- Obligations : 15%
- Titres de créance à court terme : 10%

Le gestionnaire peut dévier de l'allocation indiquée ci-dessus en faisant des choix tactiques basés sur ses anticipations de marché.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

En vertu des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance de ManCo et conformément aux Principes pour l'investissement responsable des Nations Unies, le compartiment exclut tout investissement direct dans des titres émis par des sociétés impliquées dans des activités hautement controversées (telles que la production de tabac et d'armes controversées) et/ou en violation grave des principes du Pacte mondial des Nations Unies.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt, les futures d'indices d'actions et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque lié aux matières premières

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Offensief
sous son nom abrégé ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Offensief
ou AAV Beleggingsfonds Offensief

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---------------|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU0752955020 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|-------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 0,75% | - | - | 0,18% | 0,05% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription ⁽²⁾ | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat ⁽²⁾ |
|-------------|---|---|-------------------------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Ce compartiment a été lancé le 12 mars 2012.

Le 29 juillet 2014 : le compartiment a changé de catégorie de compartiments, passant de la catégorie « Fonds de fonds » à la catégorie « Profil ».

L'ancien nom était « Verzekeringen Profile 5 ».

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Offensief **sous son nom abrégé ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Offensief** **ou AAV Beleggingsfonds Zeer Offensief**

ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Offensief

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de catégories d'actifs variées, offrant une large distribution des risques sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment peut investir dans des obligations, des actions et des instruments du marché monétaire à travers des investissements directs, des instruments financiers dérivés ainsi que des organismes de placement collectif (y compris des fonds négociés en bourse). Outre ces types d'actifs, le compartiment peut être exposé aux matières premières avec une exposition maximale de 10 % aux organismes de placement collectif tels que des ETF et des ETC. L'accent est mis sur la diversification des investissements à l'échelle mondiale.

L'objectif est de tirer profit des opportunités d'investissement permettant de créer de la valeur en gérant activement un portefeuille de valeurs mobilières.

Le gestionnaire cherchera à maintenir un profil de risque agressif. Il privilégiera les actions tout en gérant le risque en investissant, de manière secondaire, dans des titres porteurs d'intérêts d'échéances diverses. Les investissements sur les marchés émergents sont limités à 20 %.

Le gestionnaire répartira ses actifs nets selon l'allocation stratégique suivante :

- Actions : 90 %
- Obligations : 0%
- Titres de créance à court terme : 10%

Le gestionnaire peut dévier de l'allocation indiquée ci-dessus en faisant des choix tactiques basés sur ses anticipations de marché.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

En vertu des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance de ManCo et conformément aux Principes pour l'investissement responsable des Nations Unies, le compartiment exclut tout investissement direct dans des titres émis par des sociétés impliquées dans des activités hautement controversées (telles que la production de tabac et d'armes controversées) et/ou en violation grave des principes du Pacte mondial des Nations Unies.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures d'indices d'action et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque lié aux matières premières

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Offensief
sous son nom abrégé ABN AMRO Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Offensief
ou AAV Beleggingsfonds Zeer Offensief

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|---------------|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU0752955293 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion ⁽¹⁾ | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽²⁾ |
|-------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 0,75% | - | - | 0,18% | 0,05% |

(1) Dans la mesure où la Société investit dans des OPCVM et autres OPC gérés par le même promoteur, aucun compartiment de la Société ne paiera doublement les Commissions de gestion.

(2) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription ⁽²⁾ | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat ⁽²⁾ |
|-------------|---|---|-------------------------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Ce compartiment a été lancé le 12 mars 2012.

Le 29 juillet 2014 : le compartiment a changé de catégorie de compartiments, passant de la catégorie « Fonds de fonds » à la catégorie « Profil ».

L'ancien nom était « Verzekeringen Profile 6 ».

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Global Balanced

sous son nom abrégé ABN AMRO Global Balanced

ABN AMRO Funds Global Balanced

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré de catégories d'actifs variées, offrant une large distribution des risques sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi. Dans un souci de diversification, cela comprendra des investissements sur l'ensemble de la courbe des taux, sans concentration particulière sur une partie ou un point précis de la courbe.

Politique d'investissement

Le compartiment est activement géré entre différentes catégories d'actifs telles que des actions, des obligations, des instruments du marché monétaire par le biais d'investissements directs, des instruments financiers dérivés, ainsi que des organismes de placement collectif (y compris des fonds négociés en bourse).

L'objectif est de générer des rendements à un niveau de risque modérément élevé en gérant activement un portefeuille de valeurs mobilières. Le gestionnaire s'efforcera de maintenir un profil de risque intermédiaire. Il investira dans des titres porteurs d'intérêts d'échéances diverses, ainsi que dans des actions.

Les restrictions suivantes s'appliquent au compartiment :

- Exposition minimale aux actions : 20 %
- Exposition maximale aux actions : 75 %
- Exposition maximale aux titres de créance à haut rendement et des marchés émergents : 20 %
- Exposition minimale aux titres de créance (obligations et instruments du marché monétaire) : 25 %
- Exposition maximale aux titres de créance (obligations et instruments du marché monétaire) : 80 %

Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs, mais peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des Actifs « distressed » (en difficulté).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 70 % du portefeuille.

Le compartiment investira uniquement dans des fonds externes qui sont considérés comme relevant de l'article 8 ou de l'article 9 du règlement SFDR ou détenteurs d'un label de durabilité européen. Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres, les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt, les futures d'indices d'actions et les futures de change) ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

La méthode de calcul du Portefeuille de référence est disponible sur le site Internet suivant : www.msci.com.

ABN AMRO Funds Global Balanced sous son nom abrégé ABN AMRO Global Balanced

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement

ABN AMRO Investment Solutions

Conseiller externe

ABN AMRO Bank N.V. Succursale belge

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque lié aux dérivés
- Risque de liquidité
- Risque lié aux obligations à haut rendement

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU2229463448 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| | DIS | LU2229463521 | | Oui | | |
| Catégorie B | CAP | LU2229463794 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| | DIS | LU2229463877 | | Oui | | |
| Catégorie I | CAP | LU2229463950 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |
| | DIS | LU2229464099 | | Oui | | |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,50% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie B | 1,20% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie I | 0,60% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie B | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

ABN AMRO Funds Global Balanced
sous son nom abrégé ABN AMRO Global Balanced

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 9 juillet 2021.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Flexible Allocation Fund

sous son nom abrégé ABN AMRO Flexible Allocation Fund

ABN AMRO Funds Flexible Allocation Fund

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital sur le long terme grâce à un portefeuille diversifié et activement géré de fonds OPCVM, qui investissent dans une large gamme de valeurs mobilières à l'échelle mondiale, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment investira principalement dans des OPCVM afin d'obtenir une exposition à des catégories d'actifs diversifiées et multiples (y compris des actions et des titres de créance de toute qualité de crédit, des titres convertibles, des instruments du marché monétaire et des devises). L'approche d'investissement repose sur une mise en œuvre flexible des vues d'allocation du gestionnaire d'investissement au niveau de la catégorie d'actifs, de la région et du secteur, sans aucune restriction spécifique dans la proportion allouée à une catégorie d'investissement.

Les allocations entre les catégories d'actifs seront effectuées à la discrétion du gestionnaire d'investissement, soit pour maintenir une allocation dynamique entre les actions et les instruments de créance, soit pour adopter des stratégies d'investissement opportunistes en fonction des conditions du marché des actions et des instruments de créance.

Le compartiment investira ses actifs nets dans des fonds ayant été sélectionnés conformément à un certain nombre de critères qualitatifs et quantitatifs. L'analyse qualitative permet d'apprécier la stabilité et la force du gestionnaire d'investissement, ainsi que le processus et la philosophie d'investissement qu'il applique. Le processus de sélection quantitative vise à retenir uniquement les fonds ayant fait leurs preuves en matière de performance ajustée au risque.

Le compartiment détiendra 10 fonds sous-jacents en moyenne, avec un maximum de 15 fonds.

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment, et dans des Instruments du marché monétaire, y compris des certificats de dépôt et des dépôts à court terme.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) à des fins d'investissement, de couverture et de gestion efficace de portefeuille ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Certains des OPCVM sous-jacents peuvent investir dans des instruments financiers dérivés (y compris les TRS), des opérations financières sur titres et dans les marchés émergents, y compris la Chine, afin de mener leur propre politique d'investissement.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement

ABN AMRO Investment Solutions

Conseiller externe

ABN AMRO Bank N.V. Succursale belge

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risques liés aux OPCVM dans lesquels le compartiment investit
- Risque lié aux marchés d'actions
- Risque de crédit
- Risque de taux d'intérêt
- Risque de change

ABN AMRO Funds Flexible Allocation Fund
sous son nom abrégé ABN AMRO Flexible Allocation Fund

- Risque lié aux dérivés
- Risque de liquidité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie A | CAP | LU2229464768 | Oui | Non | Tous | 100 EUR |
| | DIS | LU2229464842 | | Oui | | |
| Catégorie B | CAP | LU2229464925 | Oui | Non | Investisseurs clients des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |
| | DIS | LU2229465062 | | Oui | | |
| Catégorie I | CAP | LU2229465146 | Oui | Non | Investisseurs institutionnels, Gestionnaires, OPC | 1 000 000 EUR |
| | DIS | LU2229465229 | | Oui | | |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie A | 1,50% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie B | 0,85% | - | - | 0,18% | 0,05% |
| Catégorie I | 0,50% | - | - | 0,15% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie A | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie B | 5,00% | 1,00% | 1,00% |
| Catégorie I | - | - | - |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---------------------------|--------------------------------|---|------------------------------|
|---------------------------|--------------------------------|---|------------------------------|

ABN AMRO Funds Flexible Allocation Fund
sous son nom abrégé ABN AMRO Flexible Allocation Fund

| | | | |
|---|--------------------------|--|--|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Trois jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+3) ⁽¹⁾ |
|---|--------------------------|--|--|

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment a été lancé le 4 juin 2021.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

sous son nom abrégé ABN AMRO Portfolio Global Equities

ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions mondiales, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi. Pour sélectionner les titres éligibles, le gestionnaire effectue une analyse financière et extra-financière selon des critères ESG (environnementaux, sociaux, de gouvernance) en association avec des filtres d'exclusion.

Politique d'investissement

Le compartiment est activement géré en investissant dans diverses stratégies (actives et passives) déléguées à plusieurs gestionnaires d'investissement ou par le biais d'investissements dans des fonds. Le compartiment permet une allocation entre différents styles, stratégies de marché et zones géographiques dans les marchés d'actions. Le processus de sélection de ces gestionnaires d'investissement externes et de ces fonds repose sur une évaluation qualitative autour de cinq piliers (équipe de recherche, équipe de direction, philosophie, processus et gestion du risque), sur une analyse quantitative (évaluation des risques et des performances) et sur la due diligence opérationnelle.

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières, de sociétés situées dans le monde entier y compris dans les marchés émergents.

L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir jusqu'à 30 % de ses actifs nets dans des marchés émergents.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % de son actif net dans des actions chinoises (Actions A), libellées en CNH, qui sont cotées sur la Bourse de Hong Kong via le Shanghai-Hong Kong et Shenzhen Stock Connect.

Le compartiment peut également investir dans des titres de créance (tels que des obligations à taux fixe et variable, des Instruments du marché monétaire, y compris des obligations à haut rendement) à concurrence de 10 % de ses actifs nets, notamment à des fins de gestion de trésorerie. Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 70 % du portefeuille.

Le compartiment investira uniquement dans des fonds externes qui sont considérés comme relevant de l'article 8 ou de l'article 9 du règlement SFDR ou détenteurs d'un label de durabilité européen. Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le compartiment peut avoir recours à des positions non complexes sur instruments financiers dérivés ou utiliser des instruments financiers dérivés uniquement à des fins d'investissement, de couverture ou de gestion efficace de portefeuille.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Portfolio Global Equities

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement

ABN AMRO Investment Solutions

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque opérationnel et risque de conservation
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risques spécifiques liés aux investissements en Chine
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie G | CAP | LU2445655496 | Oui | Non | Investisseurs clients de la Gestion de portefeuille discrétionnaire des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et ayant conclu un accord de commissions spécifique et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie G | 1,50% | - | - | 0,18 % | 0,01 % |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie G | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Portfolio Global Equities

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment sera lancé à une date non encore déterminée par le Conseil d'administration.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

sous son nom abrégé ABN AMRO Portfolio Global ESG Equities

ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'actions mondiales, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi. Pour sélectionner les titres éligibles, le gestionnaire effectue une analyse financière et extra-financière selon des critères ESG (environnementaux, sociaux, de gouvernance) en association avec des filtres d'exclusion. Le portefeuille est composé d'émetteurs qui sont des leaders dans les bonnes pratiques ESG.

Politique d'investissement

Le compartiment est activement géré en investissant dans diverses stratégies déléguées à plusieurs gestionnaires d'investissement ou par le biais d'investissements dans des fonds. Le compartiment permet une allocation entre différents styles, stratégies de marché et zones géographiques dans les marchés d'actions. Le processus de sélection de ces gestionnaires d'investissement externes repose sur une évaluation qualitative autour de cinq piliers (équipe de recherche, équipe de direction, philosophie, processus et gestion du risque), sur une analyse quantitative (évaluation des risques et des performances) et sur la due diligence opérationnelle.

Le compartiment investit principalement dans des valeurs mobilières telles que des actions et autres participations en capital comme les parts de coopératives et certificats de participation émis par, ou les bons de souscription de valeurs mobilières, de sociétés situées dans le monde entier y compris dans les marchés émergents.

L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment. De plus, le compartiment investira un minimum de 75 % de ses actifs nets dans des titres de capital.

Le compartiment peut investir jusqu'à 30 % de ses actifs nets dans des marchés émergents.

Le compartiment peut investir jusqu'à 10 % de son actif net dans des actions chinoises (Actions A), libellées en CNH, qui sont cotées sur la Bourse de Hong Kong via le Shanghai-Hong Kong et Shenzhen Stock Connect.

Le compartiment peut également investir dans des titres de créance (tels que des obligations à taux fixe et variable, des Instruments du marché monétaire, y compris des obligations à haut rendement) à concurrence de 10 % de ses actifs nets, notamment à des fins de gestion de trésorerie. Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 90 % du portefeuille.

Le compartiment investira uniquement dans des fonds externes qui sont considérés comme relevant de l'article 8 ou de l'article 9 du règlement SFDR ou détenteurs d'un label de durabilité européen. Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le compartiment peut avoir recours à des positions non complexes sur instruments financiers dérivés ou utiliser des instruments financiers dérivés uniquement à des fins d'investissement, de couverture ou de gestion efficace de portefeuille.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities sous son nom abrégé ABN AMRO Portfolio Global ESG Equities

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement

ABN AMRO Investment Solutions

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque opérationnel et risque de conservation
- Risque lié aux marchés émergents
- Risque lié aux sociétés de petite capitalisation et aux secteurs spécialisés ou restreints
- Risques spécifiques liés aux investissements en Chine
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions des compartiments sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement du compartiment. Les Investisseurs institutionnels sont éligibles pour une catégorie d'actions spéciale lorsque leurs investissements excèdent un seuil prédéterminé.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie G | CAP | LU2445655579 | Oui | Non | Investisseurs clients de la Gestion de portefeuille discrétionnaire des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et ayant conclu un accord de commissions spécifique et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie G | 1,50% | - | - | 0,18 % | 0,01 % |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie G | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities
sous son nom abrégé ABN AMRO Portfolio Global ESG Equities

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 16 h 00 CET le jour précédant le Jour de valorisation de la VNI (J-1) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment sera lancé à une date non encore déterminée par le Conseil d'administration.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds **sous son nom abrégé ABN AMRO Portfolio High Quality Bonds**

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'obligations consolidées libellées en euro, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment est activement géré en investissant dans diverses stratégies (actives et passives) déléguées à plusieurs gestionnaires d'investissement ou par le biais d'investissements dans des fonds. Le compartiment permet une allocation entre différentes stratégies de marché et zones géographiques dans l'univers des obligations. Le processus de sélection de ces gestionnaires d'investissement externes et de ces fonds repose sur une évaluation qualitative autour de cinq piliers (équipe de recherche, équipe de direction, philosophie, processus et gestion du risque), sur une analyse quantitative (évaluation des risques et des performances) et sur la due diligence opérationnelle.

Le compartiment investit principalement dans des obligations de qualité investment grade et autres titres à taux fixe ou variable libellés en euro. Afin d'atteindre son objectif, le compartiment peut également avoir recours à une variété d'instruments, dont, entre autres, des contrats à terme de taux, des contrats de change à terme (incluant les contrats de change à terme non livrables), des futures de taux d'intérêt, des futures d'obligations et des swaps négociés de gré à gré tels que des swaps de taux d'intérêt, des swaps de défaut de crédit et des stratégies (par exemple, des stratégies axées sur la courbe de rendement et l'arbitrage par le biais d'investissements dans les titres et les instruments dérivés indiqués ci-dessus). L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment sera tenu, pour les 40 % du total de ses actifs nets restants et sur une base consolidée, de respecter toutes les limitations établies au regard des investissements en titres/instruments mentionnés ci-dessous :

- (i) 10 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des obligations à haut rendement ;
- (ii) 25 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des obligations convertibles et autres titres de créance liés à des actions ;
- (iii) un tiers maximum du total des actifs nets du compartiment peut être investi dans des instruments du marché monétaire, dont, entre autres, des certificats de dépôt, des dépôts à court terme et des dépôts bancaires à vue ;
- (iv) 10 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des valeurs mobilières.

Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs, mais peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des Actifs « distressed » (en difficulté).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 70 % du portefeuille.

Le compartiment peut investir :

- jusqu'à 10 % du total de ses actifs nets dans des fonds passifs ou quantitatifs externes et/ou des ETF qui sont considérés comme relevant de l'article 6 du règlement SFDR pour lesquels l'univers d'investissement est conforme aux règles internes de la Société de gestion pour relever de l'article 8 ou de l'article 9.
- jusqu'à 10 % du total de ses actifs nets dans des Fonds passifs externes et/ou des ETF qui sont considérés comme relevant de l'article 6 du règlement SFDR. Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) à des fins d'investissement, de couverture et de gestion efficace de portefeuille ;

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds sous son nom abrégé ABN AMRO Portfolio High Quality Bonds

- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement

ABN AMRO Investment Solutions

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque de crédit
- Risque lié aux dérivés
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie G | DIS | LU2445655652 | Oui | Oui | Investisseurs clients de la Gestion de portefeuille discrétionnaire des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et ayant conclu un accord de commissions spécifique et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie G | 0,80% | - | - | 0,18% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie G | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds
sous son nom abrégé ABN AMRO Portfolio High Quality Bonds

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment sera lancé à une date non encore déterminée par le Conseil d'administration.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

sous son nom abrégé ABN AMRO Portfolio High Quality ESG Bonds

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

Objectif d'investissement

Fournir une appréciation du capital à moyen terme avec un portefeuille diversifié et activement géré d'obligations consolidées libellées en euro, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi.

Politique d'investissement

Le compartiment est activement géré en investissant dans diverses stratégies déléguées à plusieurs gestionnaires d'investissement, par le biais d'investissements dans des fonds, ou directement gérées par le Gestionnaire d'investissement. Le compartiment permet une allocation entre différentes stratégies de marché et zones géographiques dans l'univers des obligations. Le processus de sélection de ces gestionnaires d'investissement externes et de ces fonds repose sur une évaluation qualitative autour de cinq piliers (équipe de recherche, équipe de direction, philosophie, processus et gestion du risque), sur une analyse quantitative (évaluation des risques et des performances) et sur la due diligence opérationnelle.

Le compartiment investit principalement dans des obligations de qualité investment grade et autres titres à taux fixe ou variable libellés en euro. Afin d'atteindre son objectif, le compartiment peut également avoir recours à une variété d'instruments, dont, entre autres, des contrats à terme de taux, des contrats de change à terme (incluant les contrats de change à terme non livrables), des futures de taux d'intérêt, des futures d'obligations et des swaps négociés de gré à gré tels que des swaps de taux d'intérêt, des swaps de défaut de crédit et des stratégies (par exemple, des stratégies axées sur la courbe de rendement et l'arbitrage par le biais d'investissements dans les titres et les instruments dérivés indiqués ci-dessus). L'allocation d'actifs minimale sur une base consolidée (investissements directs et indirects) pour de tels titres représentera 60 % des actifs nets du compartiment.

Le compartiment sera tenu, pour les 40 % du total de ses actifs nets restants et sur une base consolidée, de respecter toutes les limitations établies au regard des investissements en titres/instruments mentionnés ci-dessous :

- (i) 10 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des obligations à haut rendement ;
- (ii) 25 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des obligations convertibles et autres titres de créance liés à des actions ;
- (iii) un tiers maximum du total des actifs nets du compartiment peut être investi dans des instruments du marché monétaire, dont, entre autres, des certificats de dépôt, des dépôts à court terme et des dépôts bancaires à vue ;
- (iv) 10 % maximum du total des actifs nets du compartiment peuvent être investis dans des valeurs mobilières.

Le compartiment n'est pas habilité à investir dans des actifs non productifs, mais peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans des Actifs « distressed » (en difficulté).

Le compartiment peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des dépôts bancaires à vue, y compris des liquidités détenues auprès d'une banque sur des comptes courants accessibles à tout moment.

Politique d'investissement durable

Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers tel que présenté dans le Livre I.

L'analyse extra-financière couvre au moins 90 % du portefeuille.

Le compartiment investira uniquement dans des fonds externes qui sont considérés comme relevant de l'article 8 ou de l'article 9 du règlement SFDR ou détenteurs d'un label de durabilité européen. Les fonds externes peuvent s'écarter de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion s'appliquant aux investissements directs.

Dans le cadre de la Politique d'investissement durable de la Société de gestion, le compartiment respecte les ensembles d'exclusions applicables aux produits d'investissement relevant de l'article 8+.

Des informations concernant les caractéristiques environnementales ou sociales et/ou les objectifs durables des compartiments concernés selon le niveau II du règlement SFDR sont disponibles dans l'« Annexe 2 » du Livre II du présent Prospectus.

Instruments dérivés

Le compartiment peut chercher à minimiser l'exposition aux fluctuations de change en couvrant ses transactions contre le risque de change par le biais d'instruments financiers dérivés tels que décrits à l'Annexe 2 du prospectus intégral.

Le recours aux instruments financiers dérivés est restreint aux :

- instruments cotés conformes à la politique d'investissement (dont, entre autres les futures de taux d'intérêt, les futures d'obligations, les futures de swaps de taux d'intérêt et les futures de change) à des fins d'investissement, de couverture et de gestion efficace de portefeuille ;
- instruments négociés de gré à gré à des fins de couverture de change (dont, entre autres, les contrats à terme de gré à gré et les contrats de change à terme).

Le recours aux instruments négociés de gré à gré à des fins autres que de couverture de change (dont, entre autres, les dérivés négociés de gré à gré et les contrats CDS et CDO) est interdit.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds sous son nom abrégé ABN AMRO Portfolio High Quality ESG Bonds

Relation avec le Portefeuille de référence

Ce compartiment est activement géré et est comparé au Portefeuille de référence tel que décrit à l'Annexe 2 à des fins d'indicateur de performance et de niveau de risque. Toutefois, la référence à ce Portefeuille de référence ne constitue ni un objectif ni une limitation de la gestion et de la composition du portefeuille et le compartiment ne limite pas son univers aux composantes du Portefeuille de référence.

Le Portefeuille de référence n'évalue ni n'inclut ses composants sur la base de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas aligné sur les caractéristiques ESG promues par le compartiment.

Par conséquent, les rendements peuvent s'écarter sensiblement de la performance du Portefeuille de référence.

Gestionnaire d'investissement

ABN AMRO Investment Solutions

Profil de risque

Risques spécifiques du compartiment :

- Risque de contrepartie
- Risque de crédit
- Risque lié aux dérivés
- Risque de durabilité

Pour avoir un aperçu des risques génériques, veuillez vous reporter à l'Annexe 3 du Livre I du Prospectus.

Profil d'investisseur type

Les actions du compartiment sont offertes tant aux investisseurs particuliers qu'institutionnels qui visent l'objectif d'investissement.

Catégories d'actions

| Catégorie | Sous-catégorie | Code ISIN | Enregistrement | Dividendes | Investisseurs | Participation minimale ⁽¹⁾ |
|-------------|----------------|--------------|----------------|------------|--|---------------------------------------|
| Catégorie G | CAP | LU2445655736 | Oui | Oui | Investisseurs clients de la Gestion de portefeuille discrétionnaire des sociétés affiliées de ABN AMRO Bank ou ABN AMRO Group et ayant conclu un accord de commissions spécifique et investisseurs autorisés | 5 000 EUR |

(1) Ces montants de participation minimale peuvent être supprimés à la discrétion du Conseil d'administration. Dans une telle éventualité, la Société s'assurera que les investisseurs concernés sont traités sur un pied d'égalité.

Commissions et frais

Commissions et frais récurrents maximums à payer par le compartiment

| Catégorie | Commission de gestion | Commission de performance | Commission de distribution | Autres commissions | Taxe d'abonnement ⁽¹⁾ |
|-------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------------|
| Catégorie G | 0,80% | - | - | 0,18% | 0,01% |

(1) La Société peut être, en outre, soumise au paiement de l'impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres prélèvements imposés par les autorités dans le pays où le compartiment est enregistré à des fins de distribution.

Commissions et frais non récurrents maximums à payer par l'investisseur aux agents de placement

| Catégorie | Commission de souscription | Commission de conversion ⁽¹⁾ | Commission de rachat |
|-------------|----------------------------|---|----------------------|
| Catégorie G | 5,00% | 1,00% | 1,00% |

(1) En cas de conversion dans un compartiment doté d'une commission de souscription plus élevée, la différence pourra être facturée

Informations supplémentaires

Devise de comptabilité et devise de référence :

L'EUR est la devise de libellé du compartiment.

Valeur nette d'inventaire (VNI) :

EUR

Chaque jour entièrement ouvrable au Luxembourg, sous réserve que les marchés financiers sur lesquels sont négociés une part significative (environ 50 %) des actifs du compartiment soient ouverts au moins un jour après celui ayant servi de base de calcul à la VNI précédente.

La VNI du compartiment est disponible au siège social de la Société, auprès des agents locaux ainsi que dans toutes les revues préparées par le Conseil d'administration et sur le site Internet www.abnamroinvestmentsolutions.com.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds
sous son nom abrégé ABN AMRO Portfolio High Quality ESG Bonds

Conditions de souscription/conversion/rachat :

Les ordres de souscription, rachat et conversion seront traités sur la base d'une VNI inconnue conformément aux règles définies ci-dessous, uniquement pendant les jours de négociation au Luxembourg. L'heure indiquée est celle du Luxembourg.

| Centralisation des ordres | Date de transaction des ordres | Calcul de la VNI et date de publication | Date de règlement des ordres |
|---|--------------------------------|--|---|
| 10 h 00 CET le Jour de valorisation de la VNI (J) | Jour de valorisation (J) | Jour suivant le Jour de valorisation (J+1) | Deux jours maximum d'ouverture des banques après le Jour de valorisation (J+2) ⁽¹⁾ |

(1) Si le jour de règlement tombe un jour férié, le règlement s'effectuera le jour ouvrable suivant.

Inscription à la cote :

Néant

Données historiques :

Le compartiment sera lancé à une date non encore déterminée par le Conseil d'administration.

Régime fiscal :

Il est recommandé aux actionnaires potentiels de se renseigner dans leur pays d'origine, de résidence ou de domicile sur les éventuelles implications fiscales de leur investissement.

ABN AMRO Funds

Annexes précontractuelles conformément au règlement (UE) 2022/1288

Annexe 1 – Règlement SFDR et Règlement européen sur la taxonomie

| Nom du Compartiment | Article 6 du SFDR | Article 8 du SFDR | Article 8+ du SFDR | Article 9 du SFDR | Taxonomie |
|--|-------------------|-------------------|--------------------|-------------------|-----------|
| ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities | | | | X | |
| ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Aristotle US Equities | X | | | | |
| ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds | | | X | | |
| ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds | | | X | | |
| ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities | | | | X | |
| ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Candriam European ESG Convertibles | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Candriam Global Dividend Equities | X | | | | |
| ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Candriam Total Return Global Bonds | X | | | | |
| ABN AMRO Funds Candriam Total Return Global Equities | X | | | | |
| ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities | | | | X | |
| ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Global ESG Equities | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Insight Euro Aggregate Bonds | X | | | | |
| ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged | | | X | | |
| ABN AMRO Fund JPMorgan Asia Pacific ESG Equities | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds | | X | | | |
| ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged | | X | | | |
| ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities | | | | X | |
| ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities | | | | X | |
| ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities | | X | | | |
| ABN AMRO Funds Numeric Emerging Markets Equities | X | | | | |
| ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds | | | | X | |
| ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds | | X | | | |
| ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities | | X | | | |
| ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Pzena European Equities | X | | | | |
| ABN AMRO Funds Pzena US Equities | X | | | | |
| ABN AMRO Funds Robeco EURO ESG Government-Related Bonds | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities | | X | | | |
| ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Fund of Mandates Pacific Equities | X | | | | |
| ABN AMRO Funds Fund of Mandates Emerging Markets Equities | X | | | | |
| ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds | | X | | | |
| ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged | | X | | | |
| ABN AMRO Funds Fund of Mandates North American Equities | X | | | | |
| ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds | | X | | | |
| ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds | | | X | | |
| ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive | | | | | |
| ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive | | | | | |
| ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive | | | | | |
| ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive | | | X | | |
| ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive | | | | | |
| ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive | | | | | |
| ABN AMRO Funds Comfort Invest II | | | | | |
| ABN AMRO Funds Comfort Invest III | X | | | | |
| ABN AMRO Funds Comfort Invest IV | | | | | |
| ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Defensief | | | | | |
| ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Defensief | X | | | | |
| ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Defensief | | | | | |

ABN AMRO Funds
Annexes précontractuelles conformément au règlement (UE) 2022/1288

| | | | | | |
|--|---------|-------------------|--------------|----|--------------------------|
| ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Matig Offensief | | | | | |
| ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Offensief | | | | | |
| ABN AMRO Funds Verzekeringen Beleggingsfonds Zeer Offensief | | | | | |
| ABN AMRO Funds Global Balanced | | X | | | |
| ABN AMRO Funds Flexible Allocation Fund | X | | | | |
| ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities | | X | | | |
| ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities | | | X | | |
| ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds | | X | | | |
| ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds | | | X | | |
| nexe 2 – | Annexes | précontractuelles | conformément | au | Règlement (UE) 2022/1288 |

ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Aegon Global impact Equities

Legal entity identifier:

549300070E2RYRHKFM90

Sustainable investment objective

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: 35%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: 35%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What is the sustainable investment objective of this financial product?

ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities (“the Sub-Fund”) follows a multi-thematic sustainable investment strategy. The portfolio will be composed of companies exposed to the UN Sustainable Developments Goals (SDGs). To define the sustainable investment universe, a “pass-fail” approach is used using a set of criteria. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the sustainable objectives followed by the Sub-Fund.

ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Sustainability indicators measure how the sustainable objectives of this financial product are attained.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The analysis of certain sustainability indicators is systematically integrated into the investment decision making process. The attainment of the sustainable investment objectives is assessed by investing in securities financing economic activities that substantially contribute to the environmental and/or social objectives mentioned above. To define the sustainable investment universe, a “pass-fail” approach is used using a set of criteria. No other criteria than the one mentioned below are used to define the sustainable investment nature of an investment. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe. To be eligible for the investment universe, the Management Company uses the below criteria:

- Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is assessed by data sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed Science Based Target (SBT)", or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets.
- Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company's estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
- Having a net positive aggregated Overall SDG score. This criterion, sourced from external data provider ISS, assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer's product portfolio on the achievement of sustainability objectives that align with the UN SDGs. For corporate issuers the SDG Solutions Score considers only the most distinct objective scores, i.e., the highest positive and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solution Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.
- Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of the above se criteria or (ii) a different view of the company's impact assessment made by the investment manager and based on other sources. The basis for this differentiated view will be the ‘bottom-up’ qualitative assessment that all investment companies are subjected to before they become eligible for the investment universe.

● **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

The "Do No Significant Harm" (DNSH) principle is compiled by taking into account adverse impacts indicators listed in the Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022. The Sub-Fund takes into consideration (for some of them using proxies)

ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

all the adverse impact indicators listed in Table 1 of Annex 1 that are applicable to investee companies.

In addition, the Sub-Fund takes into consideration PAI No. 4 in Table 2 of Annex 2, applicable to investee companies, relating to investments in companies without carbon reduction initiatives. The Sub-Fund also takes into consideration PAI No. 15 of Table 3 of Annex 1, applicable to investee companies, relating to the lack of anti-corruption and anti-bribery policies.

How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

The Sub-Fund considers and mitigates adverse impacts of its investments on society and environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusions of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator “investing in companies without carbon emission reduction initiatives” (i.e. PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the optional indicator “lack of anti-corruption and anti-bribery policies” (i.e. PAI 15) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

The Sub-Fund's sustainable investments are aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights, including the principles and rights set forth in the 8 “fundamental” conventions identified in the International Labor Organization's Declaration on Fundamental Principles (covering subjects that were considered to be fundamental principles and rights at work, e.g. freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining, the elimination of all forms of forced or compulsory labour, the effective abolition of child labour, and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation) and Rights at Work and the International Bill of Human Rights. Alignment is ensured through exclusions.

ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, the Sub-Fund considers and mitigates adverse impacts of its investments on society and environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusion of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 in portfolio management decisions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator “investing in companies without carbon emission reduction initiatives” (i.e. PAI 4) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the optional indicator “lack of anti-corruption and anti-bribery policies” (i.e. PAI 15) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund considers ESG analysis at every stage of the investment process when: screening the initial universe, selecting the eligible companies, constructing the portfolio, deciding to sell a company and replace it by another company, engaging actively with a company to maximise the positive impact trajectory.

The process of selecting companies starts with applying quantitative screens on a global universe by using the external ESG data providers Sustainalytics and ISS. The first screen is performed relying on the ESG data from Sustainalytics and consist of i.) applying activity-based and norm-based exclusions and of ii.) ranking companies in their sub-industry peer groups according to their ESG risk score. Only companies that pass the exclusions tests and that are ranking within the first 50% in their sub-industry peer group are eligible. The second quantitative screen will rely on the overall SDG solutions score of the external data provider ISS ; these overall scores are composed of 15 sub-scores (tackling environmental and/or social issues) assessing in what proportion the products and solutions provided by the companies are likely positively or negatively addressing one or several of the 17 UN-Sustainable Development Goals.

Subsequentl to these quantitative screenings, a qualitative assessment of the company’s impact is performed. This step enables the investment strategy to capture aspects that the quantitative analysis might overlook. The qualitative assessment allows for a more nuanced opinion on the company's policies, future plans, and of the potential impact of corporate practices or operations on the UN SDGs. It also ensures that the universe consists only of companies in which the Management Company has a high level of satisfaction that they are aligned with the fund’s sustainable investment objective. As part of the qualitative analysis, all companies are assigned one of 5 categories based on the extent to which they are involved or finance economic activities that contribute to the UN SDGs: Leader, Improver, Influencer, Neutral and Ineligible (with all but the later big determined as ‘eligible’ as per

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

the investment strategy). The qualitative assessment may also lead to the initiation of engagement with the company.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies non-compliant with SFDR Sustainable Investments mandatory norms and conventions | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Sustainable investment eligibility criteria (the below criteria may not be cumulative):
 - Having a net positive aggregated Overall SDG score. This criterion, sourced from external data provider ISS, assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer's product portfolio on the achievement of sustainability objectives that align with the UN SDGs. For

ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

corporate issuers the SDG Solutions Score considers only the most distinct objective scores, i.e., the highest positive and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solutions Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.

- Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is assessed by data sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed Science Based Target (SBT)", or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets.
- Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company's estimated future carbon emissions are no longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
- Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of the above criteria or (ii) a different view of the company's impact assessment made by the investment manager and based on other sources. The basis for this differentiated view will be the 'bottom-up' qualitative assessment that all investment companies are subjected to before they become eligible for the investment universe.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its "Good Governance Policy", the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS "exclusion policy" are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry-established norms, as set forth below:

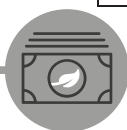
Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|--|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |

ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | | | |
|-----------------------|--|------------------------------------|---|
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |



What is the asset allocation and the minimum share of sustainable investments?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the sustainable investment process in place, hence in investments that are defined as sustainable (#1 Sustainable). The proprietary sustainable analysis covers 100% of the “#1 Sustainable” investments.” #1 Sustainable” investments include a minimum of 35% assets with environmental objectives and 35% with social objectives. Investments with environmental objectives are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy.

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Not Sustainable). “#2 Not Sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for hedging purposes. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

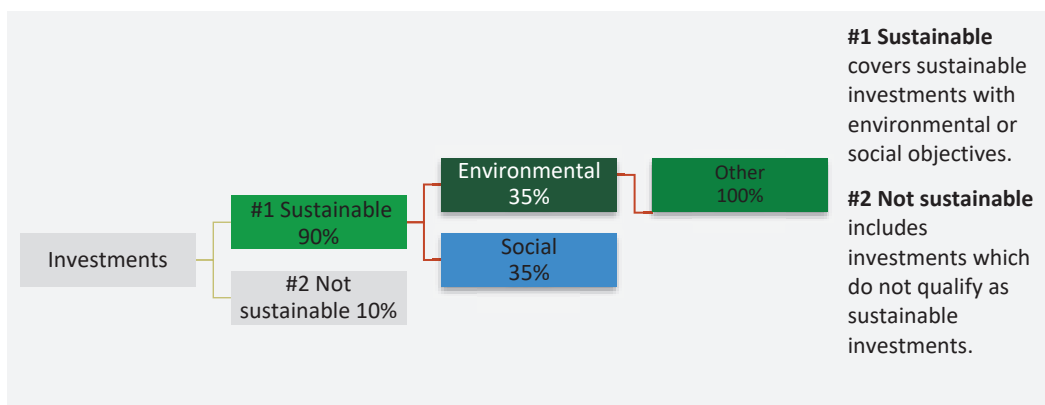
ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.



#1 Sustainable covers sustainable investments with environmental or social objectives.

#2 Not sustainable includes investments which do not qualify as sustainable investments.

● **How does the use of derivatives attain the sustainable investment objective?**

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund's sustainable investments with an environmental objective are not aligned with the EU taxonomy (i.e. 0%) as the investments with an environmental objective are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU taxonomy.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

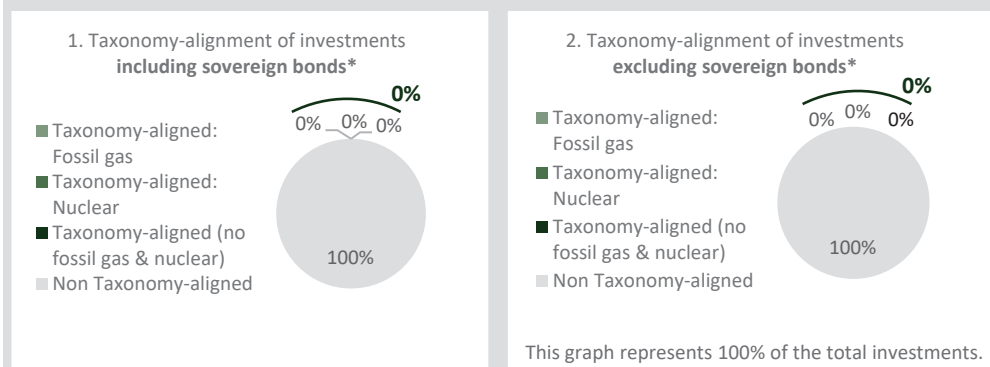
- Yes:
 - In fossil gas
 - In nuclear energy
- No

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy is 100%. The Sub-Fund commits to make a minimum of 35% sustainable investments with an environmental objective not aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund commits to make a 35% minimum share of sustainable investments with a social objective.



What investments are included under “#2 Not sustainable”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Not sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for hedging and efficient management portfolio purposes. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

ABN AMRO Funds Aegon Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to meet the sustainable investment objective?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- **How does the reference benchmark take into account sustainability factors in a way that is continuously aligned with the sustainable investment objective?**
Not Applicable
- **How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?**
Not Applicable
- **How does the designated index differ from a relevant broad market index?**
Not Applicable
- **Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?**
Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- **ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:**
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- **Documents of the Sub-Fund:**
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

Legal entity identifier:

549300Y65XF78A4B5R38

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate

ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

social responsibility policy as well as its overall sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are flexible in ESG best-practice.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment, and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Scope 1 GHG Emissions - Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions - Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

— ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

— ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding **(i)** United Nations Global Compact non-compliant companies and **(ii)** controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund invests primarily in companies domiciled or exercising a major part of their economic activity in Europe. The External Investment Manager's investment process is based on bottom-up fundamental stock selection. The Fund focuses on buying viable business models that are trading at a discount to their intrinsic value. ESG analysis is an essential pillar of the External Investment Manager's fundamental assessment of a business model. More specifically, in terms of ESG analysis, the External Investment Manager relies on ESG ratings and qualitative inputs provided by the internal ESG analysis team.

ESG is fully integrated into the stock selection process as part of the bottom-up analysis. The outcome of the ESG materiality assessment may impact the External Investment Manager's assessment in different ways. Structural ESG deterioration could potentially reduce long-term top line growth assumptions and impair the External Investment Manager's sustainable earnings power assessment and therefore reduce the company's intrinsic value. Should the External Investment Manager determine that a period of ESG weakness is temporary in nature, the External Investment Manager would be comfortable to invest in the company, however it would typically account for this weakness by (i) requiring a higher margin of safety (ii) increasing liabilities.

The External Investment Manager in-house ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. The rating is a relative rating, reflecting the ESG performance of a company compared to the average performance of its industry. To assign an ESG rating to all the companies in its universe, the External Investment Manager has developed a proprietary ESG rating methodology combining a quantitative and qualitative analysis. Using a Best-in-Class approach the ESG analysts oversee defining the most relevant quantitative ESG external data criteria for each sector and weighting them by sector. The purpose is to identify the most relevant ESG key risks and opportunities by sector.

In addition to ESG ratings, the ESG analysts integrate qualitative inputs by performing an in-depth analysis on selected issuers. The coverage of a company is triggered by (i) the requests of portfolio managers to cover non-rated issuers (ii) the level of exposure of the External Investment Manager to the investee companies (iii) the annual Engagement

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

campaign (iv) the issuers with a particularly weak ESG rating for a given criterion (v) the quarterly controversies screening.

Engagement forms an integral part to the strategy. The External Investment Manager carries out thematic and ongoing engagements. Thematic engagement revolves around themes common to several sectors, aiming to understand existing practices, promote best practice, recommend improvements, and measure progress. Ongoing engagement can cover multiple issues or themes. Specific reasons for ongoing engagement include (i) engagement around specific challenges, sustainability risks or opportunities, either for the company or its sector as a whole (ii) engagement around controversies, responding to a failure properly to manage a sustainability risk (ii) engagement with leaders, to encourage them to continue to pursue leading practice (iv) engagement with improvers, working closely with companies that wish to learn how to enhance their approach (v) engagement with laggards, working with those companies with poor performance on one or more ESG criteria (vi) engagement around the External Investment Manager policies prior to possible divestment for ESG reasons (vii) pre-AGM dialogue.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |

ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | |
|---|------|
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |
| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Companies that do not pass the external investment manager’s ESG suitability analysis. The External Investment Manager takes into account the 80% highest rated benchmark index universe, thus reducing the investment universe by 20% based on ESG criteria for the highest ESG category (or the highest rating).

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|--|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | | | |
|-----------------------|--|------------------------------------|---|
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels) | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The External Investment Manager ESG scoring is based on a proprietary ESG analysis framework, which accounts for general and sector-specific criteria, including governance criteria. In the Governance dimension, the External Investment Manager assesses an issuer’s ability to ensure an effective corporate governance framework that guarantees it will meet its long-term objectives. The governance sub-criteria considered are board structure, audit and control, remuneration, shareholders’ rights, ethics, tax practices and ESG strategy. The External Investment Manager ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. G-rated companies are excluded from the investment universe.



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

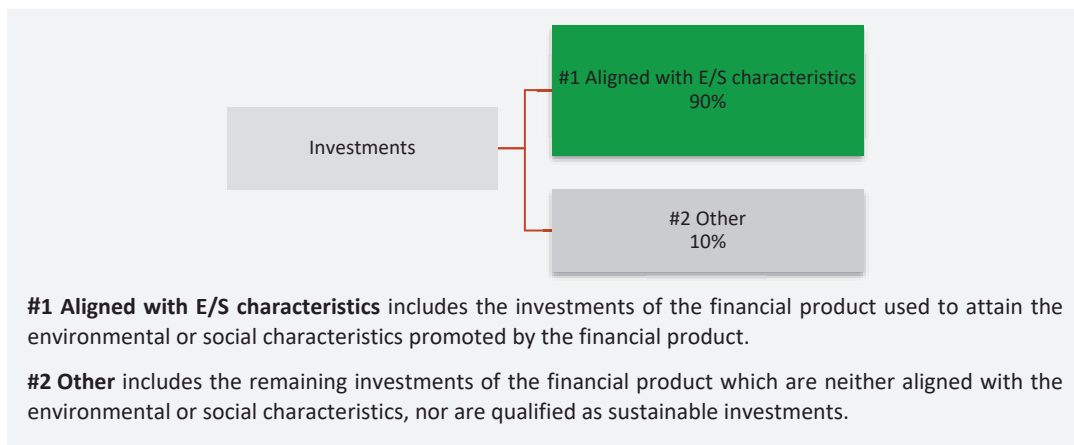
Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

Yes:

In fossil gas In nuclear energy

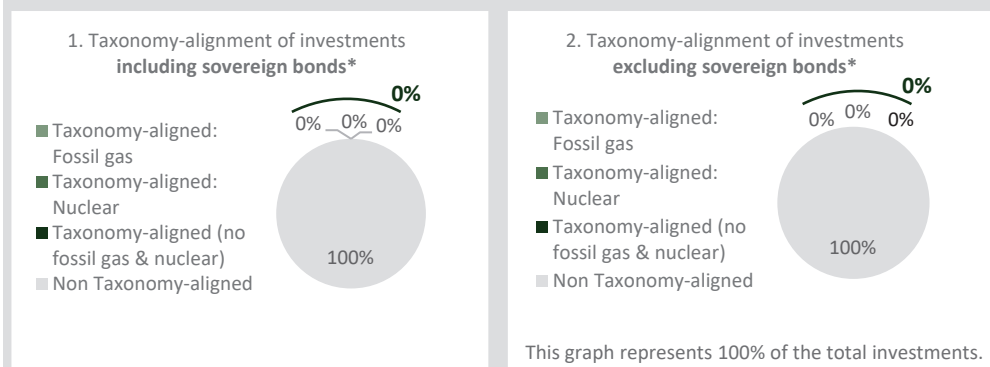
No

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus. *There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.*

ABN AMRO Funds Amundi European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***
Not Applicable
- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***
Not Applicable
- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***
Not Applicable
- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***
Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- *ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:*
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abnamro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- *Documents of the Sub-Fund:*
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

Legal entity identifier:

549300MOSLE8705NBI56

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.

ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

— *How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?*

Not Applicable

— *How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:*

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund aims to provide medium term capital growth with a diversified and actively managed portfolio of sustainable emerging market bonds. The Sub-Fund is actively managed through a top-down and bottom-up research with a strong focus on ESG research. The portfolio will be composed of issuers that are either leading in ESG practices or attractive due to their progression in ESG.

For emerging market corporate debt, an ESG review is included in credit underwriting process of each investment. Through a proprietary research, the external investment manager provides all companies held in portfolio with an internal quantitative rating. All such analysis then ultimately feeds into the analyst view of the credit, and allows them to conduct the broadest possible analysis of each underlying credit. An ESG score between 1 (Excellent) to 5 (Unfavourable) is assigned in the credit analysis and portfolio management system to the issuers that captures both the current ESG performance relative to peers as well as the outlook, which rates the momentum of the entity's ESG efforts (outlook: 1, improving; 2, stable and 3, deteriorating); the final score will result in two components: ESG score/outlook score.

The approach to country analysis begins with an analysis of high-level ESG factors; governance, institutions, transparency, policy framework and credibility. As key determinants of sovereigns' financial performance, fiscal and external deficits, public and external debt, and external liquidity, and the sustainability, or lack thereof, of that performance. The external investment manager then incorporates a mix of quantitative and qualitative analysis, leading to an overall assessment of ESG factors in the context of a country's policy framework and decision-making. Credibility and quality of a country's policy framework are pivotal to investment decisions, as the external investment manager believes they are key to determining a country's ability to withstand uncertainty and shocks, whether external, internal, political or economic, as well as environmental challenges. The analysis will result in a ESG score between 1 (Excellent) to 5 (Unfavourable) with a trend additional score (trend: 1, improving; 2, stable and 3, deteriorating); the final score will result in two components: ESG score/trend score. The external investment manager will not consider scores over 4/2 eligible for investment; the external investment manager will then perform further analysis to consider the valuation of these issuers and the appropriate time to purchase in consideration of the Fund's financial objective.

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |
| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. As part of its ESG inclusion screening and based on its own methodology and scoring systems, the External Investment Manager will consider for investment only issuers, on corporate and Sovereign sides, with a minimum overall ESG score of 4 and a minimum trend score of 2.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human |

ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | | | |
|-----------------------|-----------------------------------|----------------------|--|
| | | | rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The external investment manager’s ESG methodology incorporates an assessment of a company’s governance practices. In summary, companies are assessed against a range of factors, which include but are not limited to sound management structures, employee relations, remuneration of staff, tax compliance, board diversity and credibility of auditing arrangements.

The good governance requirements outlined in the SFDR regulation are only applicable to investments in companies. Nonetheless, the external investment manager has in place a good governance methodology when it comes to consider emerging markets state-owned companies, sovereign agencies and sovereigns.



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

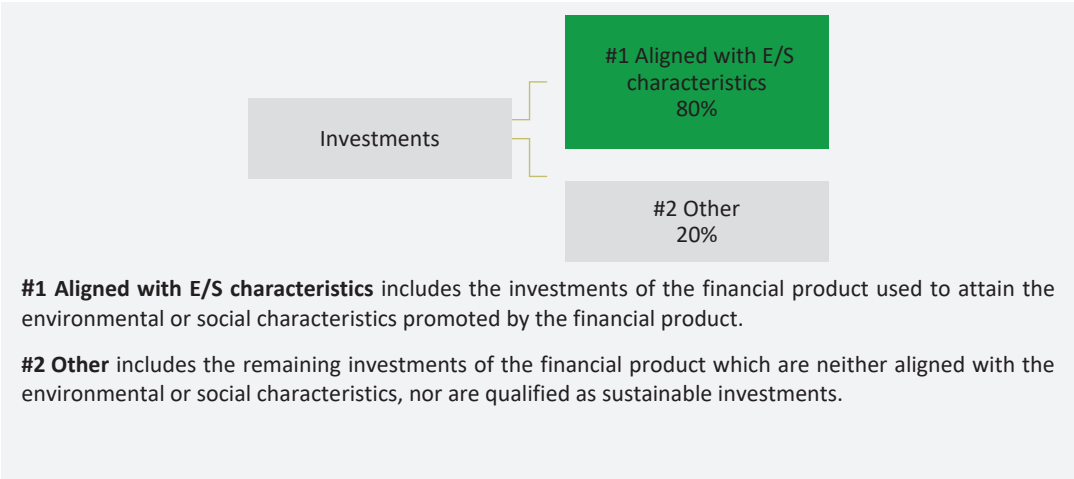
Asset allocation
describes the share
of investments in
specific assets.

ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy²?**

Yes:

In fossil gas In nuclear energy

No

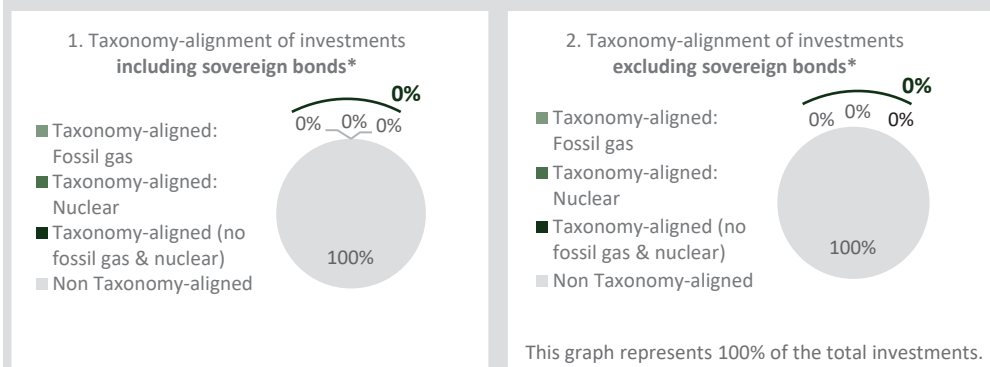
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

² Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

ABN AMRO Funds Baring Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- *ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:*
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- *Documents of the Sub-Fund:*
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

Legal entity identifier:

549300S3NCDG06TD1P08

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Manager must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.

ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria.

The External Investment Manager uses a proprietary ESG framework combining ESG negative and positive selection. The ESG assessment and selection process of the External Investment Manager differs depending on whether the investment is in Sovereign or in companies.

Regarding investments in Sovereigns: the External Investment Manager makes use of its proprietary ESG methodology to assess the ESG scores of the sovereigns composing its proprietary Sovereign sustainability index (covering to date 99 sovereign issuers). The ESG performance is based primarily of World Bank indicators. The External investment Manager will consider for investing in the Sub-Fund, Sovereigns that are in the top 75% of the Sovereign sustainability index ("best-in-universe approach") and that pass the exclusion policy of the Management Company. Regarding investments in companies: the External Investment Manager will mainly utilizes ESG data sourced from external providers for selecting the eligible companies. The External investment Manager will consider for investing in the Sub-Fund corporates that are ranked in the highest five ranking categories of the seven ranking categories currently utilized by the External Investment Manager's external ESG provider.

The External Investment Manager also uses external ESG research providers together with internal research for ongoing efforts to integrate additional ESG information into the investment process. The External Investment Manager conducts additional due diligence, which is combined with other inputs to create a mosaic of information referenced in investment decision making. These include, ESG-related specialist media and databases (e.g. Climate Disclosure Project), proxy research, and analysis published by investment banks, specialist consultancies and non-governmental organisations.

Regarding the portfolio construction, the External Investment Manager uses a two-step process which involves a top-down view being formed by its Investment Strategy Group

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

and relative value discussions leading to portfolio construction decisions made by its European Fixed Income team.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |
| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the External Investment Manager ESG suitability analysis in terms of ESG score. The External Investment Manager will only consider for inclusion in the portfolio: (i) Sovereigns that are in the top 75% of the Sovereign universe (as defined by the External Internal Manager) and (ii) corporates that are ranked in the highest five ranking categories of the seven ranking categories currently utilized by the External Investment Manager'ESG provider.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|--|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | | | |
|-----------------------|--|------------------------------------|---|
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The External investment Manager assesses good governance practices of the investee companies by combining proprietary insights with data from external ESG research providers to initially identify issuers which may not have satisfactory governance practices in relation to key performance indicators (KPIs) related to sound management structure, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

The good governance requirements outlined in the SFDR regulation are only applicable to investments in companies.



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

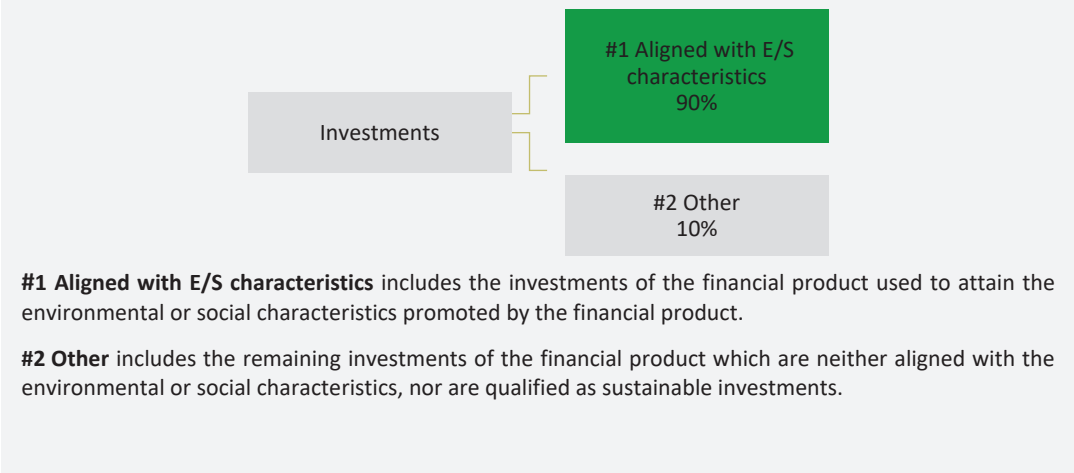
Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

Yes:

In fossil gas In nuclear energy

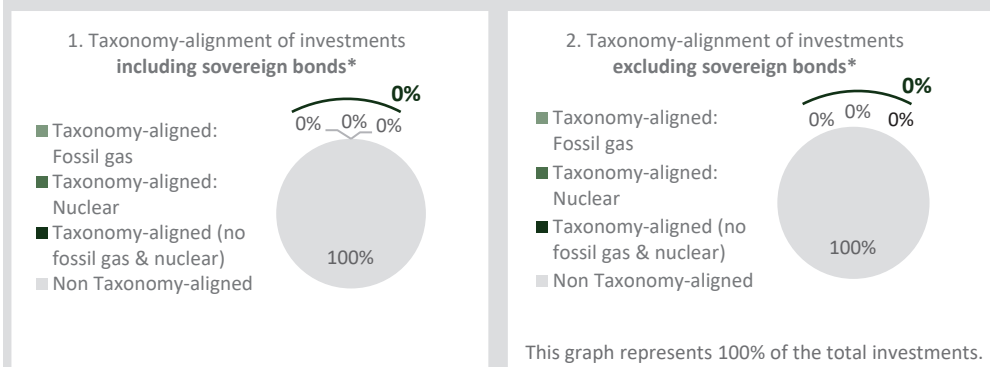
No

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.

ABN AMRO Funds Blackrock Euro Government ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

Legal entity identifier:

549300NY79BM2BZDX373

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The External Investment Manager adopts an approach to proprietary macro, credit and ESG research to help identify both long and short opportunities across a universe of alpha sources.

Conviction score is driven by assessment of fundamentals, valuation, technicals and ESG. The External Investment Manager conducts ESG analysis on corporate and sovereign issuers as part of the initial stage of the investment process which comprises of fundamental and ESG research, using its own proprietary issuer ESG evaluation framework. The analysis can be either a preliminary or detailed ESG evaluation to ensure the issuer is eligible for investment. The evaluation results in two complementary ESG metrics: a fundamental ESG Risk Rating (i.e. indicates a view on the quality of management of material ESG risks/opportunities faced by the issuer), and an investment ESG Score (i.e. reflects an investment view on the extent to which ESG factors are considered relevant/material to valuations).

The External Investment Manager will exclude from investments issuers not meeting the minimum threshold of ESG risk rating resulting from the internal analysis (have a 'very high' Fundamental ESG Risk rating), and will additionally apply restrictions on issuers which have an overall ESG score below a set threshold (<5/10 with 0 being the worst and 10 being the best) using the assessment of third party ESG information providers utilized by the External Investment Manager.

The External Investment Manager may engage with issuers of interest to further develop insights, and/or to promote change either to mitigate investment risks or protect the ESG characteristics. Insights gained from this process further inform on investment views and decisions and can potentially result in changes to the assigned ESG metrics.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences)

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |
| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. As part of the ESG inclusion selection process of the External investment Manager, are eligible for investment companies that have an overall ESG score above a set threshold (>5/10) using the assessment of third party ESG information providers utilized by the External Investment Manager.

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

- **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The External Investment Manager's ESG suitability analysis methodology incorporates an assessment of a company's governance practices. As part of the external investment manager's proprietary ESG evaluation framework, any issuer deemed to have 'very high' ESG risks on the governance pillar is automatically assigned a 'very high' Fundamental ESG (Risk) Rating overall, and consequently systematically excluded from investment.

The good governance requirements outlined in the SFDR regulation are only applicable to investments in companies. Nonetheless, the External Investment Manager has in place a good governance methodology when it comes to consider state-owned companies, sovereign agencies and sovereigns.

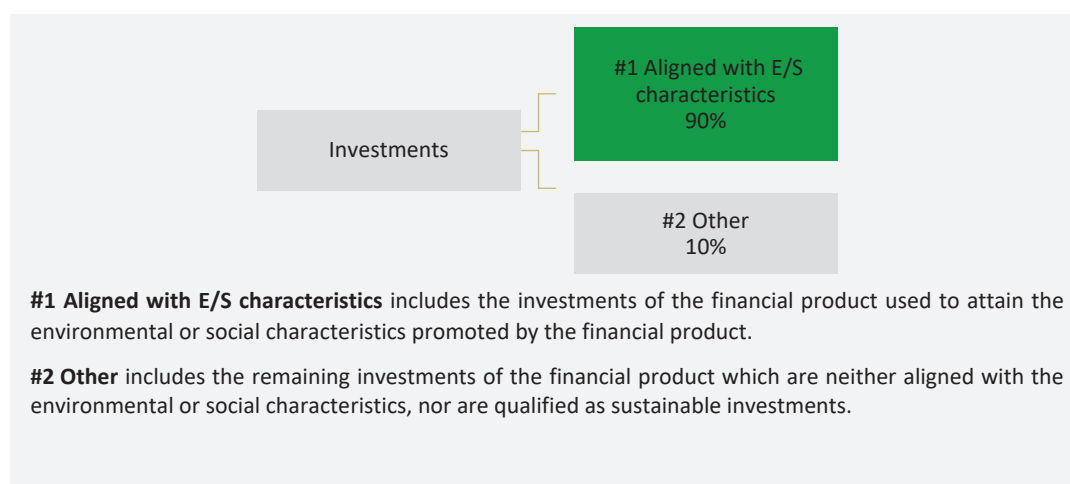


Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as "eligible" as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics)).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). "#2 Other" includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

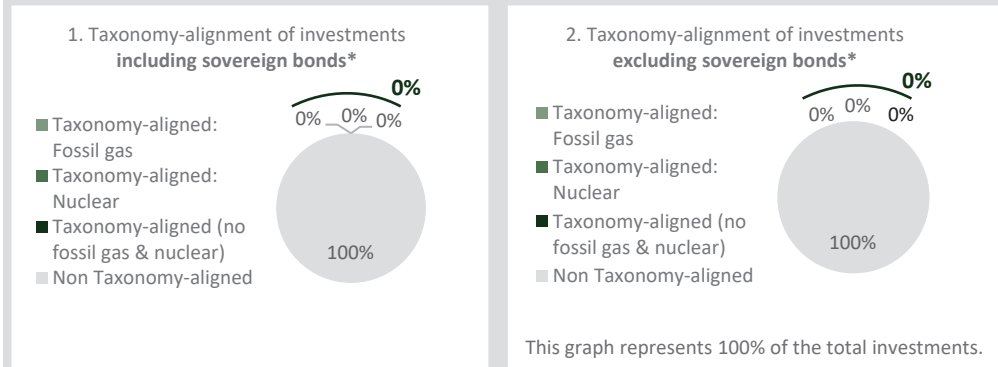
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Aggregate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

Legal entity identifier:

636700DNLWJGXU182K34

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds (the “Sub-Fund”). The External Investment Manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Manager must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions - Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The External Investment Manager adopts an approach to proprietary macro, credit and ESG research to help identify both long and short opportunities across a universe of alpha sources. Conviction score is driven by assessment of fundamentals, valuation, technicals and ESG. The External Investment Manager conducts ESG analysis on in-scope sovereign issuers (and related) as part of the initial stage of the investment process which comprises of fundamental and ESG research, using its own proprietary issuer ESG evaluation framework. The analysis can be either a preliminary or detailed ESG evaluation to ensure the issuer is eligible for investment.

The evaluation results in two complementary ESG metrics:

- Fundamental ESG Risk Rating : indicates a view on the quality of management of material ESG risks/opportunities faced by the issuer (resulting from the risk exposure it faces and the quality of mitigation efforts). There can only be one Fundamental ESG Rating per issuer across the External Investment Manager. The Fundamental ESG (Risk) Rating ranges from 'Very Low ESG risks' to 'Very High ESG risks'.
- Investment ESG Score which reflects the investment view on the extent to which the ESG factors are considered relevant to valuations, as well as the nature of that materiality (i.e. positive, negative, neutral). This is a security/instrument specific assessment and as such there may be multiple Investment ESG Scores for a single issuer depending on the held security. The Indicative Investment ESG Score ranges from -3 (very high ESG investment-related risks) to +3 (very high investment opportunities because of ESG considerations).

Complementing the External Investment Manager ESG integration approach is engagement, which describes the interaction between investors and issuers and other key stakeholders. The External Investment Manager believes that providers of debt do have a role in engaging with issuers and other relevant stakeholders on matters with the potential to impact investment returns, which may include ESG-related ones. In general the External Investment Manager may engage with issuers on ESG factors if these are deemed to represent ESG risks. Whilst issuers are usually the primary focus of engagement for corporate investment strategies, engagement with non-issuer stakeholders (such as

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

politicians, financial institutions, industry associations, and/or specialist political advisers / consultants) are more of a common feature for sovereign debt investing.

The External Investment Manager may engage with issuers of interest to further develop insights, and/or to promote change either to mitigate investment risks or protect the ESG characteristics. Insights gained from this process further inform on investment views and decisions and can potentially result in changes to the assigned ESG metrics.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

● ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding ESG requirements result from (i) ESG Exclusions / Screening; (ii) Norms-Based Screening; and (iii) ESG Integration. A number of sources provided by the Management Company and the External Investment Manager apply to the Sub-Fund as follows:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table, meaning that investment should pass the following test:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >5% |

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
|---|-----|
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Exclusion of the companies that do not pass the External Investment Manager ESG suitability analysis. The External Investment Manager considers for exclusion of the portfolio issuers which have been rated by the External Investment Manager as having “Very High” or “High” Fundamental ESG (Risk) Rating.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of the investment strategy.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

The good governance requirements outlined in the SFDR regulation are only applicable to investments in companies.

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the Management Company “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|--|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | | | |
|-----------------------|--|------------------------------------|---|
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The Sub-Fund invests predominantly in sovereign issuers and thus the “good governance” test does not apply to this category of issuers.

Nonetheless, the External Investment Manager has in place a good governance methodology when it comes to consider state-owned companies, sovereign agencies and sovereigns, where as part of the Investment Manager’s proprietary ESG evaluation framework, any issuer deemed to have ‘very high’ ESG risks on the governance pillar is automatically assigned a ‘very high’ Fundamental ESG (Risk) Rating overall, and consequently systematically excluded from investment..



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

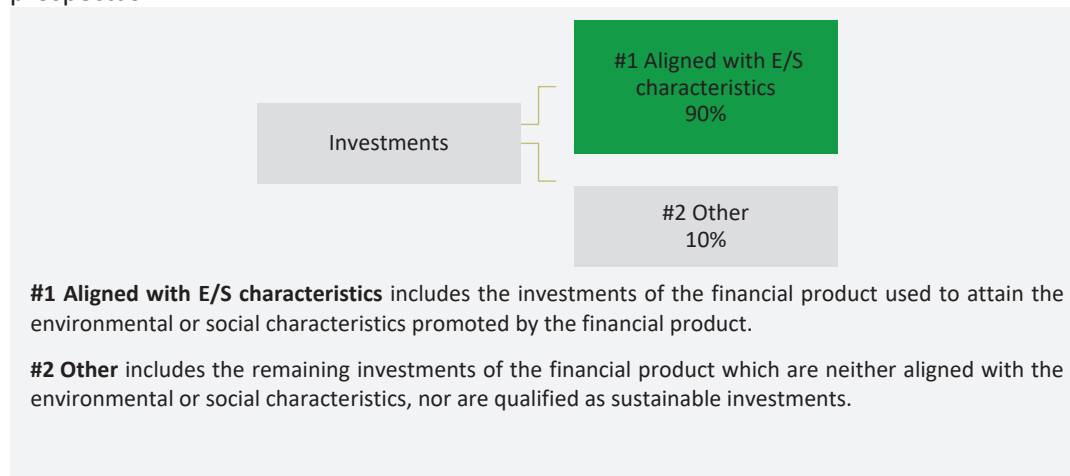
ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

prospectus.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy²?**

Yes:

In fossil gas In nuclear energy

No

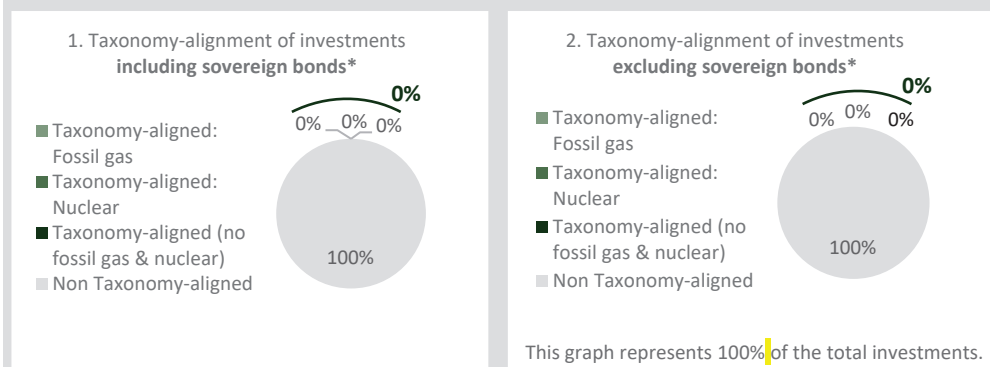
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

² Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

ABN AMRO Funds RBC BlueBay Euro Government Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities

Legal entity identifier:

636700ZWYDAMOG8CPE12

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities (the "Sub-Fund"). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the "Management Company") ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are flexible in ESG best-practice.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions - Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions - Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

The external investment manager integrates ESG analysis at every stage of its investment process: in the initial selection of the investable universe, in the idea generation process, in the stock analysis phase through detailed company research, identifying leaders and laggards, and in the portfolio construction phase. In the portfolio construction phase, the external investment manager's goal is to build a diversified portfolio of companies with strong ESG profiles.

The integrated investment process begins with screening the initial universe based on ESG and financial considerations (e.g., company involvement in weapons manufacturing, gambling, alcohol, tobacco, coal mining). In addition to these absolute exclusions, the external investment manager will exclude companies that do not meet its overall Comprehensive ESG Guidelines. The external investment manager's ESG research department has built a proprietary research process over the past couple decades (supported by and complemented with third-party research) to evaluate the sustainable characteristics of a broad set of global companies.

Beyond the initial universe screening, the focus of the external investment manager's research process is bottom-up and fundamental. The external investment manager has developed a dynamic "monitor list" drawing upon the fundamental inputs from both the ESG and the financial analyst teams. Using an ESG lens, the external investment manager examines the material risks and opportunities that impact companies in a specific sector. The ESG team presents the analysis of the material issues in each sector, highlighting emerging issues, best in class practices, risks, and opportunities. They also benchmark leaders and laggards in each sector, providing ideas for the financial analysts. Similarly, the financial analysts use their global sector experience and expertise to generate stock specific ideas in their sectors, monitoring holdings and candidate stocks while tracking sector, industry and market dynamics. The external investment manager combines the financial analyst's rigorous bottom-up analysis with the holistic understanding of the company's ESG profile. As a result of this integrated financial and ESG analysis, the monitor list is narrowed down to a focus list.

The portfolio management team draws from the pool of names on the focus list to create a diversified portfolio. Using the stocks which have been vetted and approved by both teams, the portfolio manager constructs the portfolio. The external investment manager assesses the financial and ESG risks and opportunities and prefers to buy the companies that have a large exposure in revenues (>50%) to the three long-term sustainable themes mentioned above (i.e., the external investment manager will qualify them as "Solutions Providers"). The external investment manager seeks companies that are sustainability leaders, with responsible practices and innovative products or services. However, in order to build a diversified portfolio, the external investment manager may also invest in high quality companies that meet or exceed the external investment manager's Comprehensive ESG guidelines but are not yet leaders in sustainability. In these instances, the external investment manager aims to raise the sustainability profile of the equity holdings by urging the management of the portfolio companies to improve upon their policies and operations through the external investment manager's active shareholder engagement. The external investment manager uses several approaches in its shareholder engagement including active dialogue, proxy voting, and other sector level strategies such as public benchmarking or improving industry standards in order to generate positive ESG momentum. In this respect, the external investment manager aligns their interest with that of the company.

ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Companies that do not pass the external investment manager's ESG suitability analysis. The integrated investment process begins with screening the initial universe based on ESG and financial considerations (e.g., company involvement in weapons manufacturing, gambling, alcohol, tobacco, coal mining). In addition to these absolute exclusions, the external investment manager will exclude companies that do not meet its overall Comprehensive ESG Guidelines.

ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

- ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The external investment manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. This external investment manager assesses prospective investments for issues relating but not limited to ownership and control, board structure, board diversity, pay practices, accounting and tax practices, political and lobbying practices, and stakeholder engagement.

The external investment manager reviews policies, such as codes of conduct and anti-bribery and corruption policies, as well as compliance infrastructure to assess governance practices. The external investment manager examines the history and pattern of corporate behaviour going back five years and assesses remediation of governance controversies.



Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

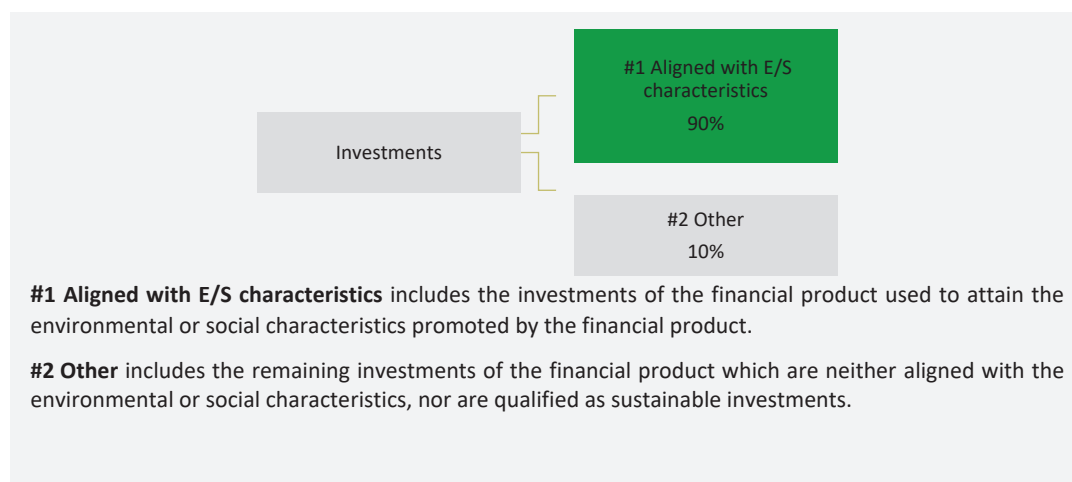
What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities

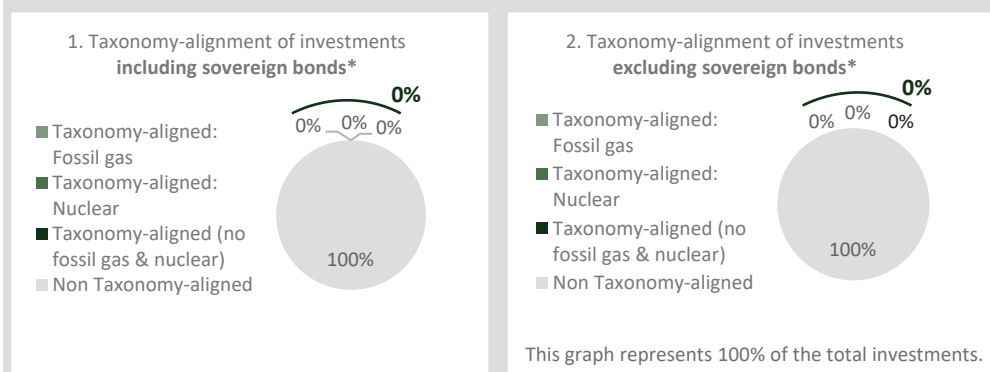
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Boston Common Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Boston Common US Sustainable Equities

Legal entity identifier:

549300M1TS3IMJWP4718

Sustainable investment objective

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: 50%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: 25%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What is the sustainable investment objective of this financial product?

ABN AMRO Boston Common US Sustainable Equities (the “Sub-Fund”) follows a multi-thematic sustainable investment strategy. The portfolio will be composed of companies exposed to three long-term sustainable themes, namely (i) climate change and earth renewal, (ii) inclusion and empowerment and (iii) health and community well-being. Within the climate change and earth renewal theme, the Sub-Fund seeks to achieve positive environmental impact by investing primarily in companies that are leading the way to a zero-carbon economy.

The sustainable investment objective of the Sub-Fund is to be aligned with the 2015 Paris Agreement, where world governments committed to curbing global temperature rise to below 2°C above pre-industrial levels. The Sub-Fund aims to achieve an aggregated portfolio temperature below 2°C, using the external data provider ISS and in particular its

ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

scenario alignment data which is based on the International Energy Agency's Sustainable Development Scenario. The approach used is based on three climate scenarios provided by the International Energy Agency (IEA) in their report World Energy Outlook 2019. The report presents three scenarios, Sustainable Development Scenario (SDS), Stated Policy Scenario (STEPS) and Current Policy Scenario (CPS). Each scenario expects a certain level of carbon budget and temperature increase in 2050. Each scenario is tied to a carbon budget. A carbon budget specifies the amount of fossil carbon that can be combusted worldwide to remain within a certain temperature. The carbon budget changes depending on scenario. For example, to remain within the limits of the SDS, less carbon can be combusted compared to the scenarios that expect a significant temperature increase i.e. the CPS. The Sub-Fund relies on the Sustainable Development Scenario pathway which is fully aligned with the Paris Agreement by holding the rise in global temperatures to “well below 2°C and pursuing efforts to limit it to 1.5°C”. The approach is in line with the expectations of the Commission Delegated Regulation (EU) 2020/1818 in terms of GHG scopes, calculations and trajectories methodologies. In addition, as part of its social sustainable investment objective, the Sub-Fund invests in companies contributing positively to social solutions. To define the sustainable investment universe, a “pass-fail” approach is used using a set of criteria. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the sustainable objectives followed by the Sub-Fund.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The analysis of certain sustainability indicators is systematically integrated into the investment decision making process. The attainment of the sustainable investment objectives is assessed by investing in securities financing economic activities that substantially contribute to the environmental and/or social objectives mentioned above. To define the sustainable investment universe, a “pass-fail” approach is used using a set of criteria. No other criteria than the ones mentioned below are used to define the sustainable investment nature of an investment. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe.

To be eligible to the investment universe, the Management Company uses the below criteria:

- o Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is assessed by data sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed Science Based Target (SBT)", or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets.
- o Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company's estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
- o Having a net positive aggregated Overall SDG Score by reference to the Sustainable Development Goals. The criterion is sourced from the external data

Sustainability indicators measure how the sustainable objectives of this financial product are attained.

ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

provider ISS. This criterion assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer's product portfolio on the achievement of sustainability objectives that align with the UN SDGs. For corporate issuers the SDG Solutions Score considers only the most distinct objectives scores, i.e., the highest positive and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solutions Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.

- o Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of the above criteria or (ii) a different view of the company's impact assessment leveraging the External Investment Manager's proprietary methodology.

How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?

The "Do No Significant Harm" (DNSH) principle is compiled by taking into account adverse impacts indicators listed in the Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022. The Sub-Fund takes into consideration (for some of them using proxies) all the mandatory adverse impact indicators listed in Table 1 of Annex 1 that are applicable to investee companies.

In addition, the Sub-Fund takes into consideration PAI No. 4 in Table 2 of Annex 2, applicable to investee companies, relating to investments in companies without carbon reduction initiatives. The Sub-Fund also takes into consideration PAI No. 15 of Table 3 of Annex 1, applicable to investee companies, relating to the lack of anti-corruption and anti-bribery policies.

How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

The Sub-Fund considers adverse impacts of its investments on society and the environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusions of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 and 16 in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator "investing in companies without carbon emission reduction initiatives" (i.e., PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the optional indicator "lack of anti-corruption and anti-bribery policies" (i.e., PAI 15) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

The Sub-Fund's sustainable investments are aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights, including the principles and rights set forth in the 8 "fundamental" conventions identified in the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work (covering subjects considered to be fundamental principles and rights at work, e.g., freedom of association and the right to collective bargaining, the elimination of all forms of forced or compulsory labour, the effective abolition of child labour, and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation) and the International Bill of Human Rights.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers adverse impacts of its investments on society and the environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusion of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 and 16 in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator "investing in companies without carbon emission reduction initiatives" (i.e., PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the optional indicator "lack of anti-corruption and anti-bribery policies" (i.e. PAI 15) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

What investment strategy does this financial product follow?

The external investment manager integrates ESG analysis at every stage of its investment process: in the initial selection of the investable universe, in the idea generation process, in the stock analysis phase through detailed company research, identifying leaders and laggards, and in the portfolio construction phase. In the portfolio construction phase, the external investment manager's goal is to build a diversified portfolio of companies with strong ESG profiles that align with three long-term sustainable themes namely climate change and earth renewal, inclusion and empowerment as well as health and community well-being.

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The integrated investment process begins with screening the initial universe based on ESG and financial considerations (e.g., company involvement in weapons manufacturing, gambling, alcohol, tobacco, coal mining). In addition to these absolute exclusions, the external investment manager will exclude companies that do not meet its overall Comprehensive ESG Guidelines. The external investment manager's ESG research department has built a proprietary research process over the past couple decades (supported by and complemented with third-party research) to evaluate the sustainable characteristics of a broad set of global companies.

Beyond the initial universe screening, the focus of the external investment manager's research process is bottom-up and fundamental. The external investment manager has developed a dynamic "monitor list" drawing upon the fundamental inputs from both the ESG and the financial analyst teams. Using an ESG lens, the external investment manager examines the material risks and opportunities that impact companies in a specific sector. The ESG team presents the analysis of the material issues in each sector, highlighting emerging issues, best in class practices, risks, and opportunities. They also benchmark leaders and laggards in each sector, providing ideas for the financial analysts. Similarly, the financial analysts use their global sector experience and expertise to generate stock specific ideas in their sectors, monitoring holdings and candidate stocks while tracking sector, industry and market dynamics. The external investment manager combines the financial analyst's rigorous bottom-up analysis with the holistic understanding of the company's ESG profile. As a result of this integrated financial and ESG analysis, the monitor list is narrowed down to a focus list.

The portfolio management team draws from the pool of names on the focus list to create a diversified portfolio. Using the stocks which have been vetted and approved by both teams, the portfolio manager constructs the portfolio. The external investment manager assesses the financial and ESG risks and opportunities and prefers to buy the companies that have a large exposure in revenues (>50%) to the three long-term sustainable themes mentioned above (i.e., the external investment manager will qualify them as "Solutions Providers"). The external investment manager seeks companies that are sustainability leaders, with responsible practices and innovative products or services. However, in order to build a diversified portfolio, the external investment manager may also invest in high quality companies that meet or exceed the external investment manager's Comprehensive ESG guidelines but are not yet leaders in sustainability. As such, companies with less than 50% of exposure to the three long-term sustainable themes mentioned above and that demonstrate average yet improving ESG profiles (i.e., the external investment manager will qualify them as "ESG Momentum") as well as companies with less than 50% of exposure to the three long-term sustainable themes mentioned above and that demonstrate leading ESG profiles relative to the industry group (i.e., the external investment manager qualify them as "ESG Leaders") are also considered for investments. In these instances, the external investment manager aims to raise the sustainability profile of the equity holdings by urging the management of the portfolio companies to improve upon their policies and operations through the external investment manager's active shareholder engagement. The external investment manager uses several approaches in its shareholder engagement including active dialogue, proxy voting, and other sector level strategies such as public benchmarking or improving industry standards in order to generate positive ESG momentum. In this respect, the external investment manager aligns their interest with that of the company.

ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies non-compliant with SFDR Sustainable Investments mandatory norms and conventions | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Companies that do not pass the external investment manager's ESG suitability analysis. The integrated investment process begins with screening the initial universe based on ESG and financial considerations (e.g., company involvement in weapons manufacturing, gambling, alcohol, tobacco, coal mining). In addition to these absolute exclusions, the external investment manager will exclude companies that do not meet its overall Comprehensive ESG Guidelines.

ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Sustainable investment eligibility criteria (the below criteria may not be cumulative):
 - Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is assessed by data sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed Science Based Target (SBT)", or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets.
 - Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company's estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
 - Having a net positive aggregated Overall SDG Score by reference to the Sustainable Development Goals. The criterion is sourced from the external data provider ISS. This criterion assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer's product portfolio on the achievement of sustainability objectives. that align with the UN SDGs For corporate issuers the SDG Solutions Score considers only the most distinct objectives scores, i.e., the highest positive and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solutions Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.
 - Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of the above criteria or (ii) a differentiated view of the company's impact assessment leveraging the External Investment Manager's proprietary methodology.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its "Good Governance Policy", the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS "exclusion policy" are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

Good governance

practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The external investment manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. This external investment manager assesses prospective investments for issues relating but not limited to ownership and control, board structure, board diversity, pay practices, accounting and tax practices, political and lobbying practices, and stakeholder engagement. The external investment manager reviews policies, such as codes of conduct and anti-bribery and corruption policies, as well as compliance infrastructure to assess governance practices. The external investment manager examines the history and pattern of corporate behaviour going back five years and assesses remediation of governance controversies.

ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

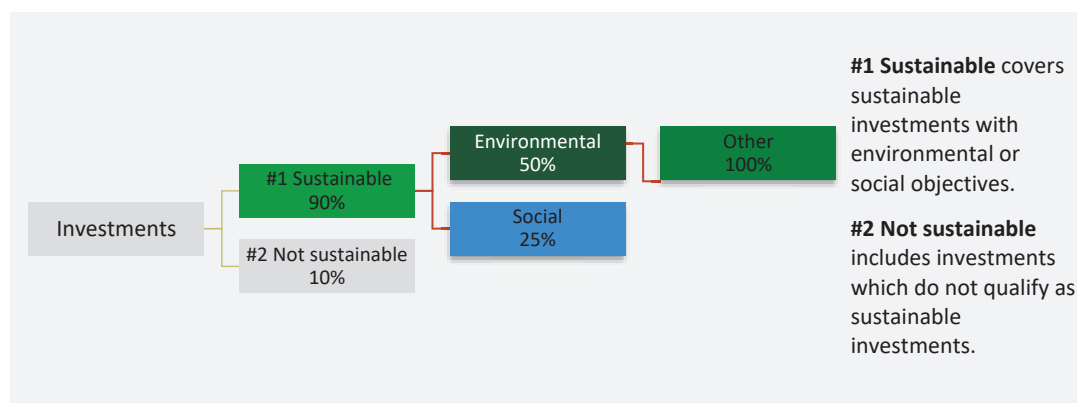
What is the asset allocation and the minimum share of sustainable investments?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the sustainable investment process in place, hence in investments that are defined as sustainable (#1 Sustainable). The external investment manager’s proprietary sustainable analysis covers 100% of the “#1 Sustainable” investments.” #1 Sustainable” investments include a minimum of 50% assets with environmental objectives and 25% with social objectives. Investments with environmental objectives are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy.

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Not Sustainable). “#2 Not Sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging purpose as a technique of portfolio management efficiency. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● **How does the use of derivatives attain the sustainable investment objective?**

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund's sustainable investments with an environmental objective are not aligned with the EU taxonomy (i.e. 0%) as the investments with an environmental objective are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU taxonomy.

ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

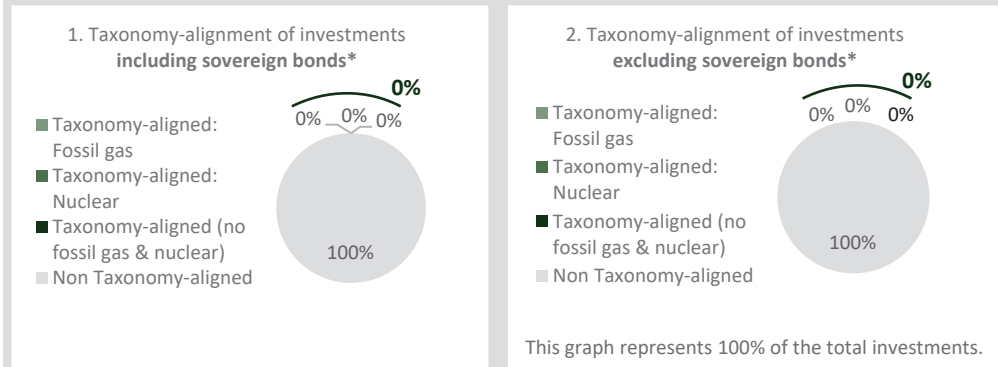
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

- Yes:
 - In fossil gas
 - In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy is 100%. The Sub-Fund commits to make a minimum of 50% sustainable investments with an environmental objective not aligned with the EU Taxonomy.

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund commits to make a 25% minimum share of sustainable investments with a social objective.



What investments are included under “#2 Not sustainable”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Not Sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging purpose as a technique of portfolio management efficiency. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.



Is a specific index designated as a reference benchmark to meet the sustainable investment objective?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- **How does the reference benchmark take into account sustainability factors in a way that is continuously aligned with the sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?**

Not Applicable

- **How does the designated index differ from a relevant broad market index?**

Not Applicable

- **Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?**

Not Applicable

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- **ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:**
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>

ABN AMRO Funds Boston Common US Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Documents of the Sub-Fund:

<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities

Legal entity identifier:

549300DK7XYE4LPM8645

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities (the "Sub-Fund"). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the "Management Company") ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are flexible in ESG best-practice.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions - Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions - Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. The strategy is actively managed through a proprietary ESG fundamental research driven approach and is complemented by an engagement approach. The ESG assessment includes a value-based screening and an in-depth ESG review.

The selection process of the external investment manager starts with the implementation of a quantitative screening by looking for data points indicative of the level of quality of the companies and on valuation criteria. The objective of this first screening is to narrow the initial universe of 1.000 companies to roughly 250. Then through fundamental analysis affirming the financial and business model sustainability quality, and the company valuation, the list is narrowed again to an “Approved list” of roughly 175 companies. Finally, the dedicated in-house ESG research and engagement team of the external investment manager (“the ESG analysts”) that is responsible for ESG exclusions and ESG assessments, will conduct an in-depth analysis to come to a “pass” or “fail” recommendation.

For each potential investment, the ESG analysts of the external investment manager seek to understand the full spectrum of the company’s product and services. The team will apply its value-based screen by excluding companies engaged in specific products or practices considering their revenue dependence, market share and severity (as weapons, gaming, tobacco, Alcohol production, in Factory farming, in nuclear power fuel cycle and in Prison operations. etc.). The team will then evaluate the overall performance in four broad categories: corporate, governance, human capital management and environmental & community impacts. Using a proprietary “materiality framework,” the ESG team of the external investment manager assesses the potential significance of ESG factors (with respect to a range of issues, encompassing both risks and opportunities) to include them into the overall assessment of the company’s quality, business model sustainability, and valuation.

The concluding step of this process is a “pass” or “fail” recommendation from the ESG analysts for each company complementing by a comprehensive report. The selection process leads to reject above 20% of the companies of the “Approved list”. The companies eligible to the strategy are put on the “Approved screened list” composed usually of 125 companies.

In complement, the external investment company may engage with companies on certain issues relying on the expertise of its in-house Active Ownership Committee composed of senior ESG professionals and portfolio managers (including the Chief Investment Officer). The team oversees the development of the firm’s core engagement strategy and plans each year.

Methodological limitations can be assessed in terms of nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. The analysis is completed relative to a set of comprehensive guidelines, assessing the company's impact on stakeholders, performance over time (relative to peers and established goals), and transparency. The concluding step of this process is a "pass" or "fail" recommendation based of the External Investment Manager.
- As part of the screening process of the external investment manager, companies involved (considering certain thresholds) in the alcohol production, in factory farming, in nuclear power fuel cycle and in prison operations are not suitable for investment.

ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

- **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities

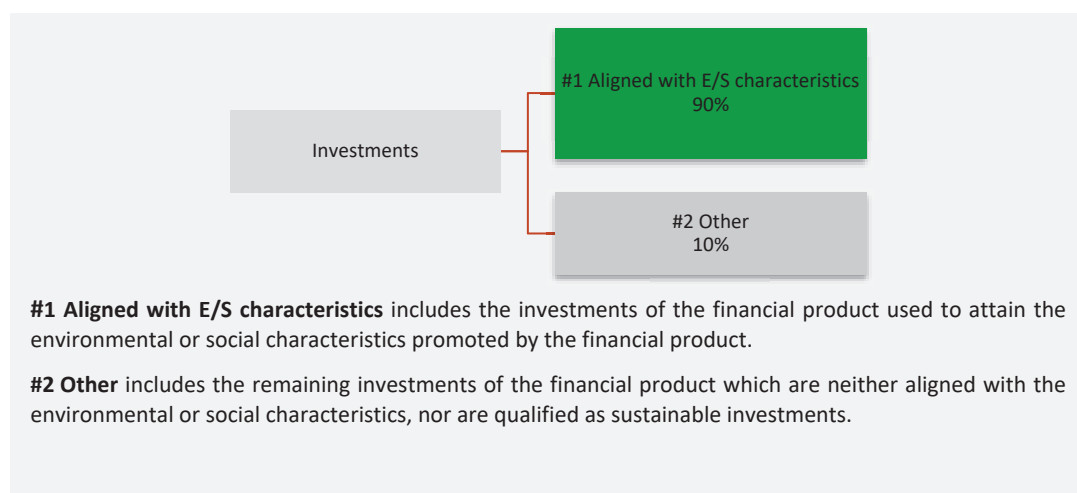
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities

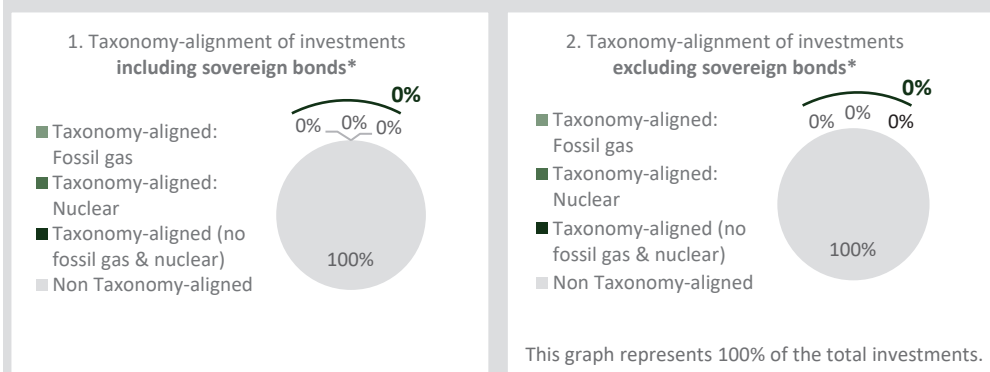
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Boston Trust Walden US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Legal entity identifier:

549300SL4OLTHYRHP145

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?



Yes



No



It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%



in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%



It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments



with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



with a social objective



It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.

ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG. The external investment manager's uses a proprietary ESG analysis, leading to ESG Rating and scoring, as well as a norms-based and activity-based controversy screening to define the investable universe for the sub fund.

On the corporate side, the external investment manager has developed an analytical framework to identify "Best in Class" companies. Companies are first selected on the basis of controversial sector exclusions and norms-based filtering. Subsequent to this selection, companies are further analysed on the basis of sector-specific development issues. These issues are approached from two distinct but related perspectives, a macro analysis (i.e. business activity analysis) and a micro analysis (i.e. stakeholder analysis). The results of the company and stakeholder analysis are combined and the external investment manager selects the companies with the top 80% scores within the investable universe.

As part of the macro analysis the external investment manager has identified 5 major long term sustainability trends that strongly influence the environment in which companies operate, affecting their future market challenges as well as their long-term growth and prosperity:

- Controversial Activities exclusion,
- Norms-Based Analysis determines whether a company complies with the 10 principles of the UN GC for each of main categories (Human rights), Labour, Environment and anti-Bribery,
- Business Activities Analysis,
- Stakeholders Analysis,
- Stewardship,

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Separately, a micro-analysis examines companies' ability to integrate the interests of six stakeholders into their long-term strategy. Stakeholder relationships create opportunities as well as risks and are thereby drivers of long-term value.

When it comes to the countries and public bonds issuers, the analysis is carried out at the country level. The external investment manager's proprietary process employs a four-pillar, quantifiable approach (i.e. human capital, natural capital, social capital, and economic capital). These four pillars incorporate a wide-range of material ESG issues that are evaluated using a set of key performance indicators. The ESG country score is calculated using a weighted average model. The four key pillars are considered to have equal importance and are therefore equally weighted. Within each pillar, the ESG issues and KPIs are weighted based on relevance.

For the supranational organisations issuing bonds, the external investment manager applies a two-steps process considering (1) the purpose of the Mission Statement Analysis (to exclusively select supranational organisations whose mission favours economic and social development of regions and countries (2). a norms-based analysis to determine whether or not the supranational organisation observes the 10 principles of the United Nations Global Compact.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |

ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | |
|---|------|
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |
| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. On the corporate side, the companies with the top 80% ESG scores and taking the External Investment Manager’s proprietary scoring methodology are considered for inclusion in the portfolio. On the countries and public bonds issuers side such as public organisations, the top 75% ESG rated countries and taking into account the External investment Manager’s proprietary methodology are considered for inclusion in the portfolio.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20%.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The external investment manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. Corporate governance is a key aspect of the corporate governance of the external investment manager's Stakeholder analysis. It allows to assess how a company interacts with and manages its relevant stakeholders and how a company's board fulfils its governance and management duties with respect to disclosure and transparency as well as the consideration of sustainability objectives.

To assess a company's governance practices, the external investment manager's ESG analysis comprises, among others, 5 key governance pillars:

- Strategic direction which assesses the independence, expertise and composition of the board and ensures that the board acts in the best interests of all

ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

shareholders and other stakeholders and can act as a counterbalance to management.

- Audit committee & auditor independence evaluation to avoid conflicts of interests.
- Transparency on executive remuneration, which enables executives and the remuneration committee to be held accountable by shareholders and helps align interests of both top executives and shareholders and focus on long term performance.
- Share capital to ensure all shareholders have equal voting rights.
- Financial conduct and transparency.

The good governance requirements outlined in the SFDR regulation are only applicable to investments in companies. Nonetheless, the external investment manager has in place a good governance methodology when it comes to consider state-owned companies, sovereign agencies and sovereigns.



Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

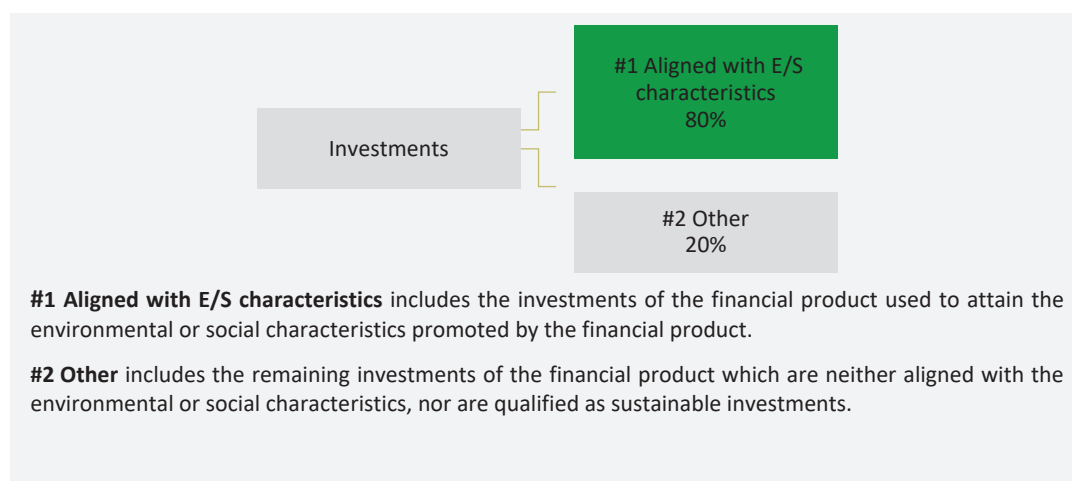
What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable

ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



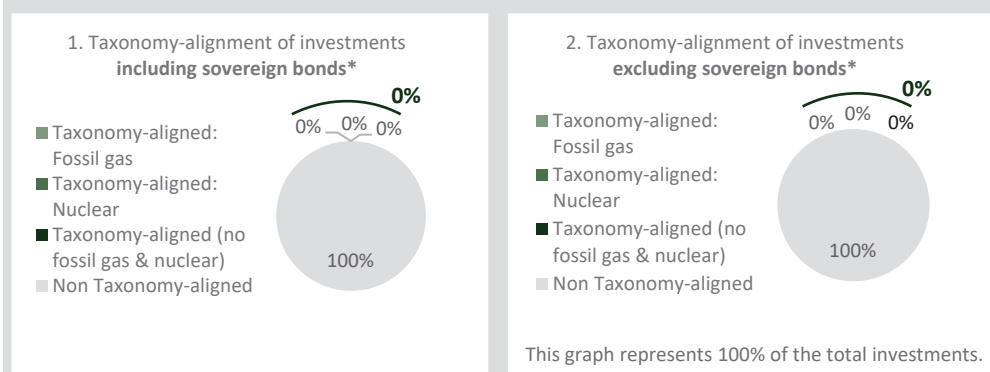
To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

ABN AMRO Funds Candriam Emerging Markets ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Legal entity identifier:

549300L09550N5VH8145

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.

ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund aims to provide short-term capital growth with a diversified and actively managed portfolio of sustainable short term bonds. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

With regard to the environmental and social sustainability aspects of the investment strategy, the external investment manager's uses a proprietary ESG analysis, leading to ESG Rating and scoring, as well as the norms-based and activity-based controversy screening to define the investable universe for the sub fund.

On the corporate side, the external investment manager has developed an analytical framework to identify "Best in Class" companies. Companies are first selected on the basis of controversial sector exclusions and norms-based filtering. Subsequent to this selection, companies are further analysed on the basis of sector-specific development issues. These issues are approached from two distinct but related perspectives, a macro analysis (i.e. business activity analysis) and a micro analysis (i.e. stakeholder analysis). The results of the company and stakeholder analysis are combined and the external investment manager selects the companies with the top 80% scores within the investable universe.

As part of the macro analysis the external investment manager has identified 5 major long term sustainability trends that strongly influence the environment in which companies operate, affecting their future market challenges as well as their long-term growth and prosperity:

- Controversial Activities exclusion,
- Norms-Based Analysis determines whether a company complies with the 10 principles of the UN GC for each of main categories (Human rights), Labour, Environment and anti-Bribery,
- Business Activities Analysis,
- Stakeholders Analysis,

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Stewardship,

Separately, a micro-analysis examines companies' ability to integrate the interests of six stakeholders into their long-term strategy. Stakeholder relationships create opportunities as well as risks and are thereby drivers of long-term value.

When it comes to the countries and public bonds issuers, the analysis is carried out at the country level. The external investment manager's proprietary process employs a four-pillar, quantifiable approach (i.e. human capital, natural capital, social capital, and economic capital). These four pillars incorporate a wide-range of material ESG issues that are evaluated using a set of key performance indicators. The ESG country score is calculated using a weighted average model. The four key pillars are considered to have equal importance and are therefore equally weighted. Within each pillar, the ESG issues and KPIs are weighted based on relevance.

For the supranational organisations issuing bonds, the external investment manager applies a two-steps process considering (1) the purpose of the Mission Statement Analysis (to exclusively select supranational organisations whose mission favours economic and social development of regions and countries (2). a norms-based analysis to determine whether or not the supranational organisation observes the 10 principles of the United Nations Global Compact.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |

ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | |
|---|------|
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |
| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. On the corporate side, the companies with the top 80% ESG scores and taking the External Investment Manager’s proprietary scoring methodology are considered for inclusion in the portfolio. On the countries and public bonds issuers side such as public organisations, the top 75% ESG rated countries and taking into account the External investment Manager’s proprietary methodology are considered for inclusion in the portfolio.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The external investment manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. Corporate governance is a key aspect of the corporate governance of the external investment manager's Stakeholder analysis. It allows to assess how a company interacts with and manages its relevant stakeholders and how a company's board fulfils its governance and management duties with respect to disclosure and transparency as well as the consideration of sustainability objectives.

To assess a company's governance practices, the external investment manager's ESG analysis comprises, among others, 5 key governance pillars:

- Strategic direction which assesses the independence, expertise and composition of the board and ensures that the board acts in the best interests of all

ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

shareholders and other stakeholders and can act as a counterbalance to management.

- Audit committee & auditor independence evaluation to avoid conflicts of interests.
- Transparency on executive remuneration, which enables executives and the remuneration committee to be held accountable by shareholders and helps align interests of both top executives and shareholders and focus on long term performance.
- Share capital to ensure all shareholders have equal voting rights.
- Financial conduct and transparency.

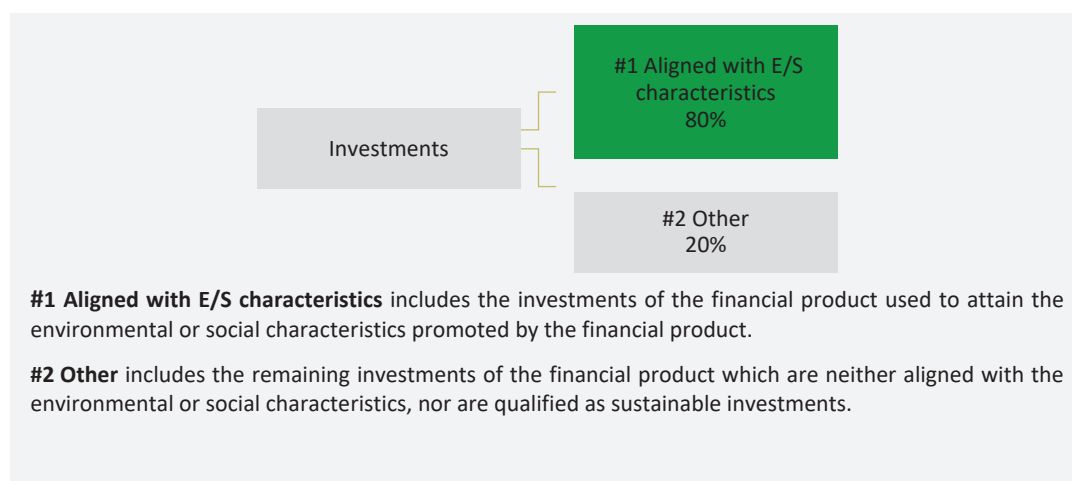
The good governance requirements outlined in the SFDR regulation are only applicable to investments in companies. Nonetheless, the external investment manager has in place a good governance methodology when it comes to consider state-owned companies, sovereign agencies and sovereigns.



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



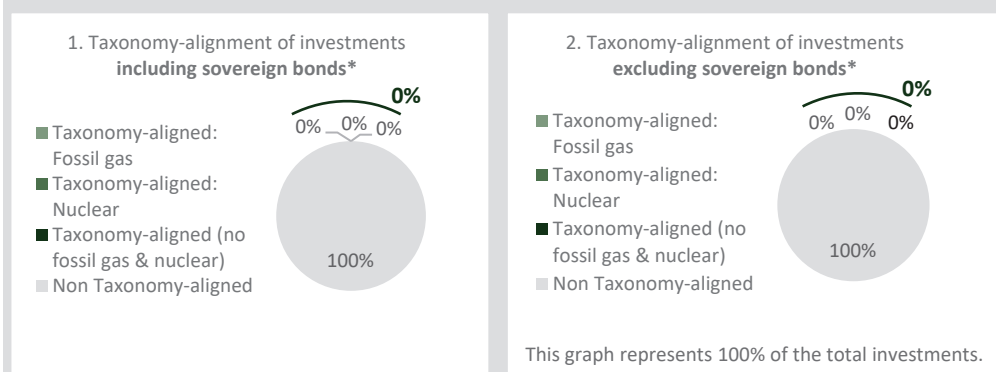
To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- **How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable

- **How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?**

Not Applicable

- **How does the designated index differ from a relevant broad market index?**

Not Applicable

- **Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?**

Not Applicable

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html):
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- [Documents of the Sub-Fund](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html):
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

ABN AMRO Funds Candriam Euro ESG Short Term Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities

Legal entity identifier:

549300CBDKNRXFQ1GZ21

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities (the “Sub-Fund”). The External Investment Manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

The External Investment Manager believes that companies which embrace sustainability-related opportunities and challenges in concert with their financial opportunities and challenges are the most likely to generate shareholder value. The Sub-Fund uses a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio is composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG. The external investment manager's uses a proprietary ESG analysis, leading to ESG Rating and scoring, as well as a norms-based and activity-based controversy screening to define the investable universe for the sub fund.

The external investment manager has developed an analytical framework to identify "Best in Class" companies. Companies are first selected on the basis of controversial sector exclusions and norms-based filtering. Subsequent to this selection, companies are further analysed on the basis of sector-specific development issues. These issues are approached from two distinct but related perspectives, a macro analysis (i.e. business activity analysis) and a micro analysis (i.e. stakeholder analysis). The results of the company and stakeholder analysis are combined and the external investment manager selects the companies with the top 50% scores within the investable universe.

As part of the macro analysis the external investment manager has identified 5 major long term sustainability trends that strongly influence the environment in which companies operate, affecting their future market challenges as well as their long-term growth and prosperity:

- Controversial Activities exclusion,
- Norms-Based Analysis determines whether a company complies with the 10 principles of the UN GC for each of main categories (Human rights), Labour, Environment and anti-Bribery,
- Business Activities Analysis,
- Stakeholders Analysis,
- Stewardship,

Separately, a micro-analysis examines companies' ability to integrate the interests of six stakeholders into their long-term strategy. Stakeholder relationships create opportunities as well as risks and are thereby drivers of long-term value.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|--|--------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | |
|---|-----------------------|
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the External Investment Manager ESG suitability analysis. As part of the ESG inclusion selection process of the External investment Manager, are eligible for investment companies that are within the top 50% of the investment universe as defined by the External Investment Manager.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The External Investment Manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. Corporate governance is a key aspect of the corporate governance of the External Investment Manager's stakeholder analysis. It allows to assess how a company interacts with and manages its relevant stakeholders and how a company's board fulfils its governance and management duties with respect to disclosure and transparency as well as the consideration of sustainability objectives.

To assess a company's governance practices, the External Investment Manager's ESG analysis comprises, among others, 5 key governance pillars:

- o Strategic direction which assesses the independence, expertise and composition of the board and ensures that the board acts in the best interests of all

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

shareholders and other stakeholders and can act as a counterbalance to management.

- o Audit committee & auditor independence evaluation to avoid conflicts of interests.
- o Transparency on executive remuneration, which enables executives and the remuneration committee to be held accountable by shareholders and helps align interests of both top executives and shareholders and focus on long term performance.
- o Share capital to ensure all shareholders have equal voting rights.
- o Financial conduct and transparency.



Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

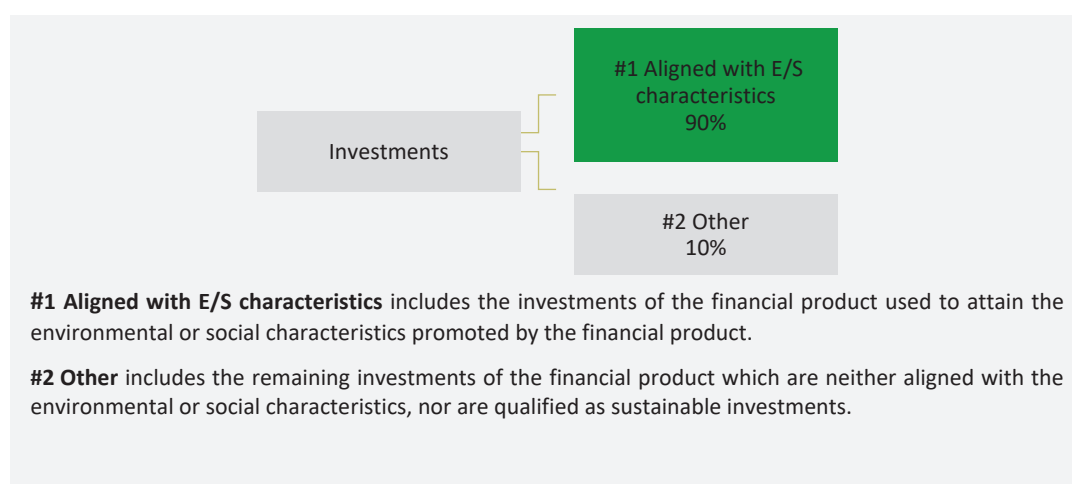
What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities

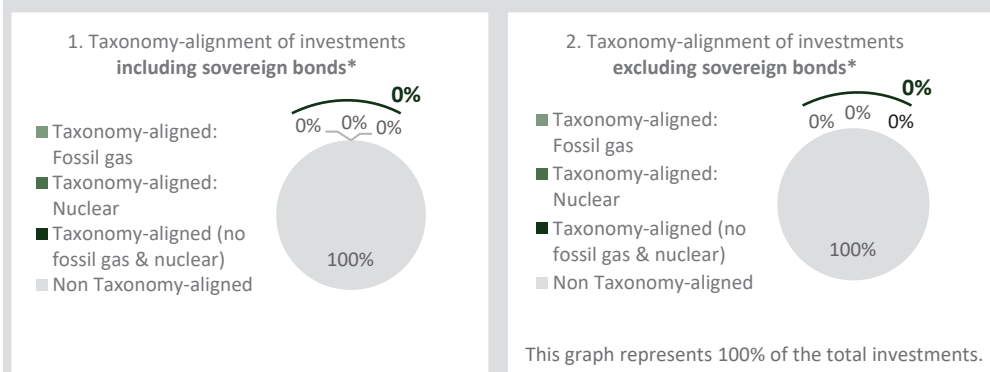
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>

- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Legal entity identifier:

549300TEOF7MMQGZFX38

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities (the "Sub-Fund"). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the "Management Company") ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

The External Investment Manager seeks reasonably priced quality growth companies which demonstrate a sustainable competitive advantage. The External Investment Manager believes that companies which embrace sustainability-related opportunities and challenges in concert with their financial opportunities and challenges are the most likely to generate shareholder value. The Sub-Fund uses a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The Sub-Fund is composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The external investment manager has developed an analytical framework to identify "Best in Class" companies. Companies are first selected on the basis of controversial sector exclusions and norms-based filtering. Subsequent to this selection, companies are further analysed on the basis of sector-specific development issues. These issues are approached from two distinct but related perspectives, a macro analysis (i.e. business activity analysis) and a micro analysis (i.e. stakeholder analysis). The results of the company and stakeholder analysis are combined and the external investment manager selects the companies with the top 70% scores within the investable universe.

As part of the macro analysis the external investment manager has identified 5 major long term sustainability trends that strongly influence the environment in which companies operate, affecting their future market challenges as well as their long-term growth and prosperity:

- Controversial Activities exclusion,
- Norms-Based Analysis determines whether a company complies with the 10 principles of the UN GC for each of main categories (Human rights), Labour, Environment and anti-Bribery,
- Business Activities Analysis,
- Stakeholders Analysis,
- Stewardship,

Separately, a micro-analysis examines companies' ability to integrate the interests of six stakeholders into their long-term strategy. Stakeholder relationships create opportunities as well as risks and are thereby drivers of long-term value.

In addition and considering the very specific nature of smaller companies, the External Investment Manager designed a portfolio-specific engagement program, taking into account small and mid-caps-specific challenges and favoring long-term dialogue and support rather than exclusion. The External Investment Manager will therefore send a specific engagement questionnaire to each issuer in order to have reliable data for a more accurate analysis and a constructive dialogue.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the External Investment Manager ESG suitability analysis. As part of the ESG inclusion selection process of the External investment Manager, are eligible for investment companies that are within the top 70% of the investment universe as defined by the External Investment Manager.
- **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

● *What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?*

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The External Investment Manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. Corporate governance is a key aspect of the corporate governance of the External Investment Manager's stakeholder analysis. It allows to assess how a company interacts with and manages its relevant stakeholders and how a

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

company's board fulfils its governance and management duties with respect to disclosure and transparency as well as the consideration of sustainability objectives.

To assess a company's governance practices, the External Investment Manager's ESG analysis comprises, among others, 5 key governance pillars:

- o Strategic direction which assesses the independence, expertise and composition of the board and ensures that the board acts in the best interests of all shareholders and other stakeholders and can act as a counterbalance to management.
- o Audit committee & auditor independence evaluation to avoid conflicts of interests.
- o Transparency on executive remuneration, which enables executives and the remuneration committee to be held accountable by shareholders and helps align interests of both top executives and shareholders and focus on long term performance.
- o Share capital to ensure all shareholders have equal voting rights.
- o Financial conduct and transparency.



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as "eligible" as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). "#2 Other" includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

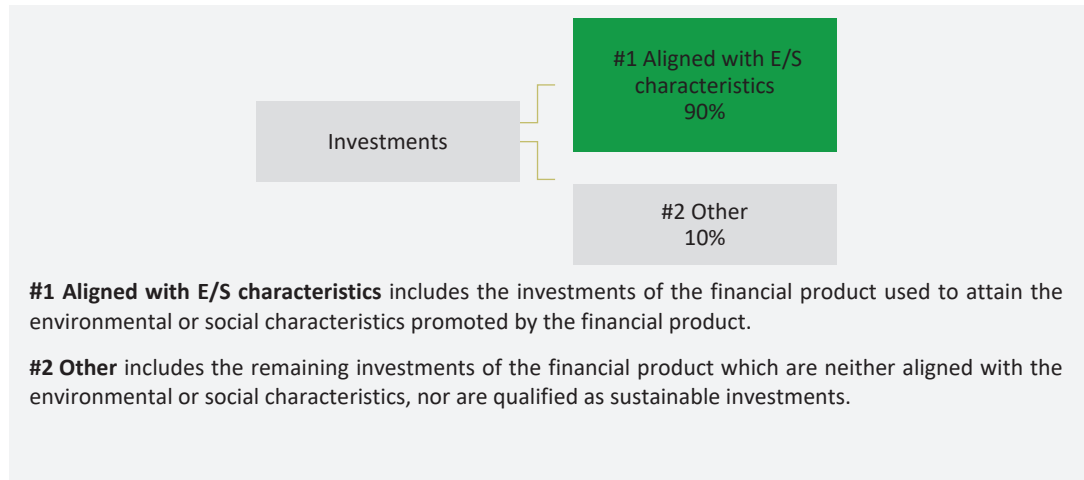
Asset allocation
describes the share
of investments in
specific assets.

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

Yes:
 In fossil gas In nuclear energy

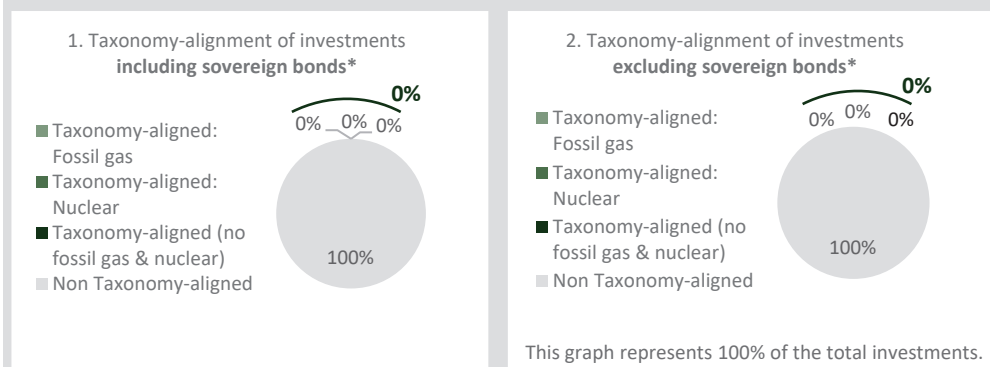
No

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

ABN AMRO Funds Candriam European ESG Smaller Companies Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ***ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:***
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abnamro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- ***Documents of the Sub-Fund:***
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities Article 8

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities

Legal entity identifier:

549300GHUFAZLYYGW322

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall sustainability strengths going from the

ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities Article 8

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities Article 8

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities Article 8

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

The External Investment Manager seeks reasonably priced quality companies which demonstrate a sustainable competitive advantage. The External Investment Manager believes that companies which embrace sustainability-related opportunities and challenges in concert with their financial opportunities and challenges are the most likely to generate shareholder value. The Sub-Fund uses a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio is composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The external investment manager has developed an analytical framework to identify "Best in Class" companies. Companies are first selected on the basis of controversial sector exclusions and norms-based filtering. Subsequent to this selection, companies are further analysed on the basis of sector-specific development issues. These issues are approached from two distinct but related perspectives, a macro analysis (i.e. business activity analysis) and a micro analysis (i.e. stakeholder analysis). The results of the company and stakeholder analysis are combined and the external investment manager selects the companies with the top 80% scores within the investable universe.

As part of the macro analysis the external investment manager has identified 5 major long term sustainability trends that strongly influence the environment in which companies operate, affecting their future market challenges as well as their long-term growth and prosperity:

- Controversial Activities exclusion,
- Norms-Based Analysis determines whether a company complies with the 10 principles of the UN GC for each of main categories (Human rights), Labour, Environment and anti-Bribery,
- Business Activities Analysis,
- Stakeholders Analysis,
- Stewardship,

Separately, a micro-analysis examines companies' ability to integrate the interests of six stakeholders into their long-term strategy. Stakeholder relationships create opportunities as well as risks and are thereby drivers of long-term value.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|--|--------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |

ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities Article 8

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | |
|---|-----------------------|
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- As part of the ESG inclusion selection process of the External investment Manager, are eligible for investment companies that score within the first 80% of the universe as defined by the External investment Manager

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities Article 8

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

Corporate governance is a key aspect of the external investment manager Stakeholder analysis. The external investment manager assesses how a company interacts with and manages its relevant stakeholders as well as how a company's board fulfils its governance and management duties with respect to disclosure and transparency as well as the consideration of sustainability objectives. To assess a company's governance practices, the external investment manager's ESG analysis comprises, among others, 5 key governance pillars:

- o Strategic direction which assesses the independence, expertise and composition of the board and ensures that the board acts in the best interests of all shareholders and other stakeholders and can act as a counterbalance to management.
- o Audit committee & auditor independence evaluation to avoid conflicts of interests.

ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities Article 8

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- o Transparency on executive remuneration, which enables executives and the remuneration committee to be held accountable by shareholders and helps align interests of both top executives and shareholders and focus on long term performance.
- o Share capital to ensure all shareholders have equal voting rights.
- o Financial conduct and transparency



Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

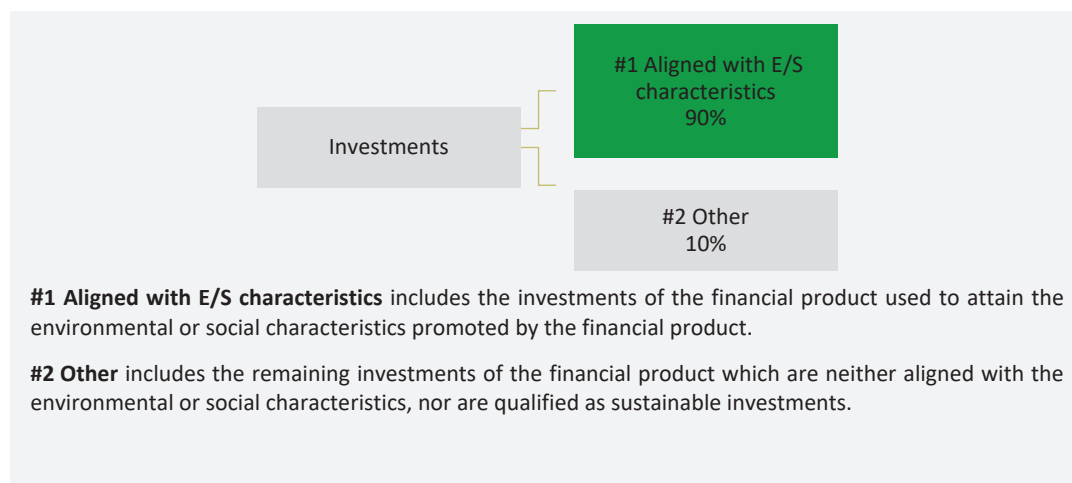
What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities Article 8

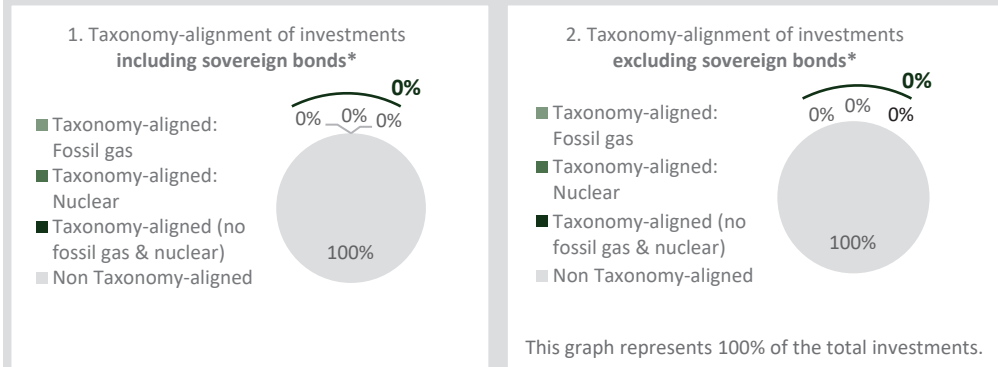
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

- Yes:
 - In fossil gas
 - In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Candriam French ESG Equities Article 8

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>

- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

Legal entity identifier:

549300GXKI14H8T43734

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

The External Investment Manager will select global convertibles bonds combining a fundamental financial analysis and a top down approach. The investment approach is based on both Credit and Equity analysis carried out by the external investment manager in order to select securities.

The external investment manager's uses a proprietary ESG analysis, leading to ESG Rating and scoring, as well as a norms-based and activity-based controversy screening to define the investable universe for the sub fund.

On the corporate side, the external investment manager has developed an analytical framework to identify "Best in Class" companies. Companies are first selected on the basis of controversial sector exclusions and norms-based filtering. Subsequent to this selection, companies are further analysed on the basis of sector-specific development issues. These issues are approached from two distinct but related perspectives, a macro analysis (i.e. business activity analysis) and a micro analysis (i.e. stakeholder analysis). The results of the company and stakeholder analysis are combined and the external investment manager selects the companies with the top 80% scores within the investable universe.

As part of the macro analysis the external investment manager has identified 5 major long term sustainability trends that strongly influence the environment in which companies operate, affecting their future market challenges as well as their long-term growth and prosperity:

- Controversial Activities exclusion,
- Norms-Based Analysis determines whether a company complies with the 10 principles of the UN GC for each of main categories (Human rights), Labour, Environment and anti-Bribery,
- Business Activities Analysis,
- Stakeholders Analysis,
- Stewardship,

Separately, a micro-analysis examines companies' ability to integrate the interests of six stakeholders into their long-term strategy. Stakeholder relationships create opportunities as well as risks and are thereby drivers of long-term value.

The results of the company analysis and of the stakeholders analysis are combined to form the ESG score; the External Investment Manager will select the companies with the top 80% scores within the investable universe.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the External Investment Manager ESG suitability analysis. The External Investment Manager will consider for inclusion into the portfolio of the Sub-Fund, companies with the top 80% ESG scores (taking the External Investment Manager's proprietary scoring methodology).
- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

● *What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?*

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The external investment manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. Corporate governance is a key aspect of the corporate governance of the external investment manager's Stakeholder analysis. It allows to assess how a company interacts with and manages its relevant stakeholders and how a

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

company's board fulfils its governance and management duties with respect to disclosure and transparency as well as the consideration of sustainability objectives.

To assess a company's governance practices, the external investment manager's ESG analysis comprises, among others, 5 key governance pillars:

- Strategic direction which assesses the independence, expertise and composition of the board and ensures that the board acts in the best interests of all shareholders and other stakeholders and can act as a counterbalance to management.
- Audit committee & auditor independence evaluation to avoid conflicts of interests.
- Transparency on executive remuneration, which enables executives and the remuneration committee to be held accountable by shareholders and helps align interests of both top executives and shareholders and focus on long term performance.
- Share capital to ensure all shareholders have equal voting rights.
- Financial conduct and transparency.



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 70% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 30% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

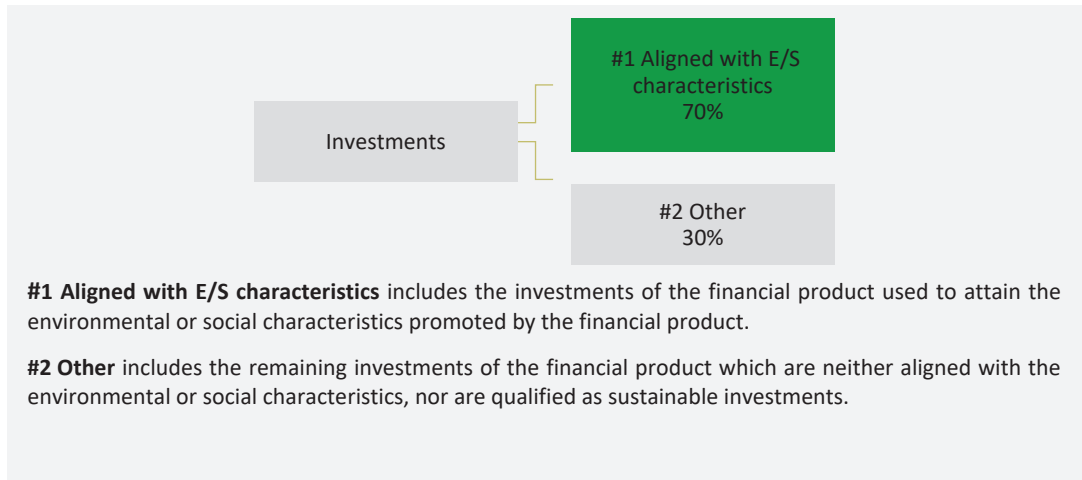
Asset allocation
describes the share
of investments in
specific assets.

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

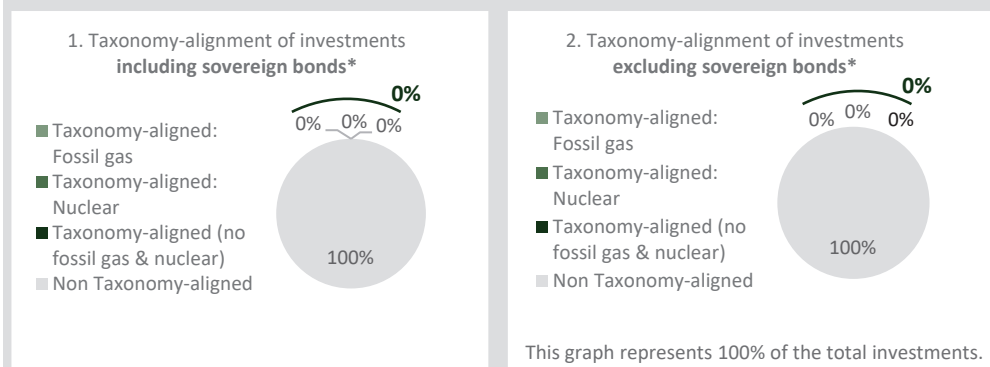
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG Convertibles

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

Legal entity identifier:

549300H8VYJL694NE413

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG. The external investment manager's uses a proprietary ESG analysis, leading to ESG Rating and scoring, as well as a norms-based and activity-based controversy screening to define the investable universe for the sub fund.

On the corporate side, the external investment manager has developed an analytical framework to identify "Best in Class" companies. Companies are first selected on the basis of controversial sector exclusions and norms-based filtering. Subsequent to this selection, companies are further analysed on the basis of sector-specific development issues. These issues are approached from two distinct but related perspectives, a macro analysis (i.e. business activity analysis) and a micro analysis (i.e. stakeholder analysis). The results of the company and stakeholder analysis are combined and the external investment manager selects the companies with the top 80% scores within the investable universe.

As part of the macro analysis the external investment manager has identified 5 major long term sustainability trends that strongly influence the environment in which companies operate, affecting their future market challenges as well as their long-term growth and prosperity:

- Controversial Activities exclusion,
- Norms-Based Analysis determines whether a company complies with the 10 principles of the UN GC for each of main categories (Human rights), Labour, Environment and anti-Bribery,
- Business Activities Analysis,
- Stakeholders Analysis,
- Stewardship,

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Separately, a micro-analysis examines companies' ability to integrate the interests of six stakeholders into their long-term strategy. Stakeholder relationships create opportunities as well as risks and are thereby drivers of long-term value.

When it comes to the countries and public bonds issuers, the analysis is carried out at the country level. The external investment manager's proprietary process employs a four-pillar, quantifiable approach (i.e. human capital, natural capital, social capital, and economic capital). These four pillars incorporate a wide-range of material ESG issues that are evaluated using a set of key performance indicators. The ESG country score is calculated using a weighted average model. The four key pillars are considered to have equal importance and are therefore equally weighted. Within each pillar, the ESG issues and KPIs are weighted based on relevance.

For the supranational organisations issuing bonds, the external investment manager applies a two-steps process considering (1) the purpose of the Mission Statement Analysis (to exclusively select supranational organisations whose mission favours economic and social development of regions and countries (2). a norms-based analysis to determine whether or not the supranational organisation observes the 10 principles of the United Nations Global Compact.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | |
|---|------|
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |
| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. On the corporate side, the companies with the top 80% ESG scores and taking the External Investment Manager’s proprietary scoring methodology are considered for inclusion in the portfolio. On the countries and public bonds issuers side such as public organisations, the top 75% ESG rated countries and taking into account the External investment Manager’s proprietary methodology are considered for inclusion in the portfolio.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The external investment manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. Corporate governance is a key aspect of the corporate governance of the external investment manager's Stakeholder analysis. It allows to assess how a company interacts with and manages its relevant stakeholders and how a company's board fulfils its governance and management duties with respect to disclosure and transparency as well as the consideration of sustainability objectives. To assess a company's governance practices, the external investment manager's ESG analysis comprises, among others, 5 key governance pillars:

- o Strategic direction which assesses the independence, expertise and composition of the board and ensures that the board acts in the best interests of all shareholders and other stakeholders and can act as a counterbalance to management.

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- o Audit committee & auditor independence evaluation to avoid conflicts of interests.
- o Transparency on executive remuneration, which enables executives and the remuneration committee to be held accountable by shareholders and helps align interests of both top executives and shareholders and focus on long term performance.
- o Share capital to ensure all shareholders have equal voting rights.
- o Financial conduct and transparency.

The good governance requirements outlined in the SFDR regulation are only applicable to investments in companies. Nonetheless, the external investment manager has in place a good governance methodology when it comes to consider state-owned companies, sovereign agencies and sovereigns.



Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

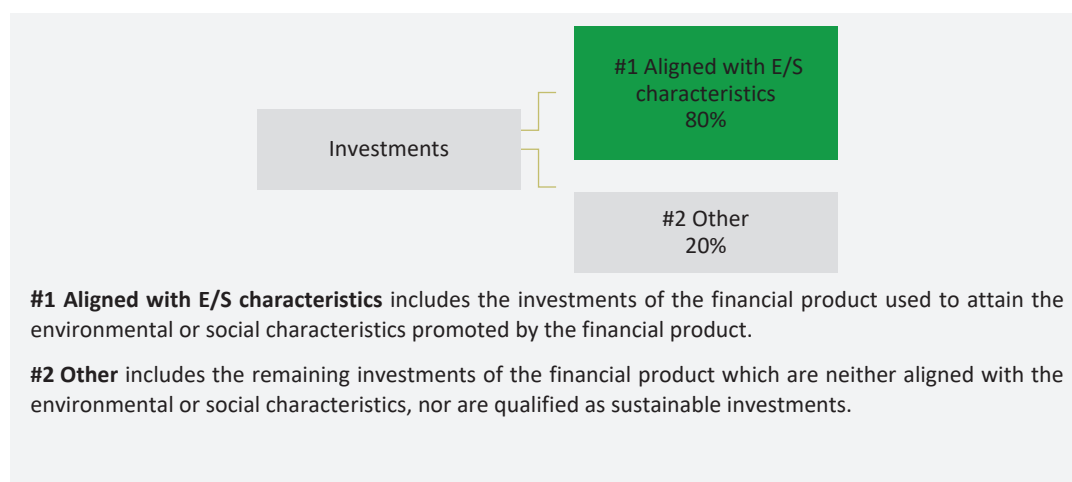
What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



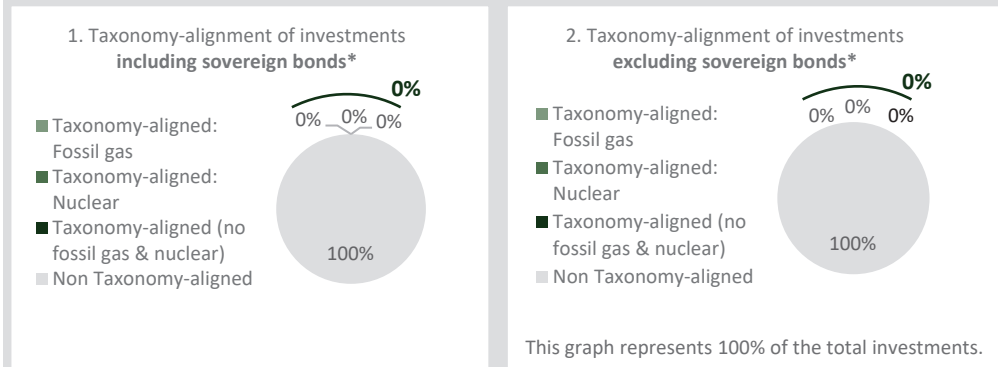
To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

ABN AMRO Funds Candriam Global ESG High Yield Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- **How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable

- **How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?**

Not Applicable

- **How does the designated index differ from a relevant broad market index?**

Not Applicable

- **Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?**

Not Applicable

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Legal entity identifier:

549300EZ6OEX5H1FKA94

Sustainable investment objective

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Yes | <input type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="checkbox"/> No |
|--|--|
| <input checked="" type="checkbox"/> It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: 50% <ul style="list-style-type: none"><input type="checkbox"/> in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy<input checked="" type="checkbox"/> in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy | <input type="checkbox"/> It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments <ul style="list-style-type: none"><input type="checkbox"/> with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy<input type="checkbox"/> with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy<input type="checkbox"/> with a social objective |
| <input checked="" type="checkbox"/> It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: 25% | <input type="checkbox"/> It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments |



What is the sustainable investment objective of this financial product?

ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities (the “Sub-Fund”) follows a multi-thematic sustainable investment strategy. The portfolio will be composed of issuers exposed to four long-term sustainable themes, namely (i) education, (ii) health and wellbeing, (iii) social infrastructure and (iv) sustainable solutions.

The sustainable investment objective of the Sub-Fund is to be aligned with the 2015 Paris Agreement, where world governments committed to curbing global temperature rise to below 2°C above pre-industrial levels. The Sub-Fund aims to achieve an aggregated portfolio temperature below 2°C, using the external data provider ISS and in particular its scenario alignment data which is based on the International Energy Agency's Sustainable Development Scenario. The approach used is based on three climate scenarios provided by the International Energy Agency (IEA) in their report World Energy Outlook 2019. The report

ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

presents three scenarios, Sustainable Development Scenario (SDS), Stated Policy Scenario (STEPS) and Current Policy Scenario (CPS). Each scenario expects a certain level of carbon budget and temperature increase in 2050. Each scenario is tied to a carbon budget. A carbon budget specifies the amount of fossil carbon that can be combusted worldwide to remain within a certain temperature. The carbon budget changes depending on scenario. For example, to remain within the limits of the SDS, less carbon can be combusted compared to the scenarios that expect a significant temperature increase i.e. the CPS. The Sub-Fund relies on the Sustainable Development Scenario pathway which is fully aligned with the Paris Agreement by holding the rise in global temperatures to “well below 2°C and pursuing efforts to limit it to 1.5°C”. The approach is in line with the expectations of the Commission Delegated Regulation (EU) 2020/1818 in terms of GHG scopes, calculations and trajectories methodologies. In addition, as part of its social sustainable investment objective, the Sub-Fund invests in companies contributing positively to social solutions. To define the sustainable investment universe, a “pass-fail” approach is used using a set of criteria. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the sustainable objectives followed by the Sub-Fund.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The analysis of certain sustainability indicators is systematically integrated into the investment decision making process. The attainment of the sustainable investment objectives is assessed by investing in securities financing economic activities that substantially contribute to the environmental and/or social objectives mentioned above. To define the sustainable investment universe, a “pass-fail” approach using a set of criteria. No other criteria than the ones mentioned below are used to define the sustainable investment nature of an investment. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe.

To be eligible to the investment universe, the Management Company uses the below criteria:

- o Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed Science Based Target (SBT)", or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets.
- o Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
- o Having a net positive aggregated Overall SDG Score by reference to the Sustainable Development Goals. The criterion is sourced from the external data provider ISS. This criterion assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer's product portfolio on the achievement of sustainability objectives. For corporate issuers the SDG Solutions Score considers only the most distinct objectives scores, i.e., the highest positive

Sustainability indicators measure how the sustainable objectives of this financial product are attained.

ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solutions Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.

- o Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of these criteria or (ii) a differentiated view of the company's impact assessment leveraging the External Investment Manager's proprietary methodology.

How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?

The "Do No Significant Harm" (DNSH) principle is compiled by taking into account adverse impacts indicators listed in the Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022. The Sub-Fund takes into consideration (for some of them using proxies) all the mandatory adverse impact indicators listed in Table 1 of Annex 1 that are applicable to investee companies.

In addition, the Sub-Fund takes into consideration PAI No. 4 in Table 2 of Annex 2, applicable to investee companies, relating to investments in companies without carbon reduction initiatives. The Sub-Fund also takes into consideration PAI No. 15 of Table 3 of Annex 1, applicable to investee companies, relating to the lack of anti-corruption and anti-bribery policies.

How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

The Sub-Fund considers adverse impacts of its investments on society and the environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusions of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator "investing in companies without carbon emission reduction initiatives" (i.e., PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the optional indicator "lack of anti-corruption and anti-bribery policies" (i.e. PAI 15) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

The Sub-Fund's sustainable investments are aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights, including the principles and rights set forth in the 8 "fundamental" conventions identified in the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work (covering subjects considered to be fundamental principles and rights at work, e.g., freedom of association and the right to collective bargaining, the elimination of all forms of forced or compulsory labour, the effective abolition of child labour, and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation) and the International Bill of Human Rights.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers adverse impacts of its investments on society and the environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusion of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 and 16 in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators:

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator "investing in companies without carbon emission reduction initiatives" (i.e., PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the optional indicator "lack of anti-corruption and anti-bribery policies" (i.e. PAI 15) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

What investment strategy does this financial product follow?

The portfolio will seek to have exposure to issuers exposed to four long-term sustainable themes, namely education, health and wellbeing, social infrastructure and sustainable solutions.

The external investment manager investment philosophy is founded on the understanding that performance and principles are inseparable when seeking to create long-term investment returns for clients. The external investment manager believes consistent, long-term returns are more likely to be achieved by investing responsibly in sustainable businesses. The Sub-Fund follows an active, long term, value orientated investment

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

philosophy identifying companies which are trading at attractive valuation levels using a variety of different metrics.

The external investment manager pursues an integrated approach whereby the investment and SRI cases of any stock idea are considered together. The initial investment universe is composed of all large and mid-cap stocks listed in developed European countries. The relatively strict ESG criteria are an important element in defining the external investment manager's final investment universe. The external investment manager applies both negative and positive screenings.

The external investment manager's in-house responsible investment experts undertake an in-depth analysis of the risk factors most applicable to the company and the sector, using a variety of sources, including company produced reports, market knowledge, and third-party research. The external investment manager aims to identify companies with a well-developed approach to ESG risk management. All investments undergo an ESG/Responsibility review, which considers six areas of business risk (i.e., environment and climate change, business ethics, community, employment and labour, human rights and corporate governance). The external investment manager seeks to see positive direction in all six ESG areas over a 3–5-year period.

As part of the process, the external investment manager embraces 4 themes (i.e., education, health and well-being, social infrastructure, and sustainable solutions) that consider positive impacts. Within the sustainable solutions theme, the Sub-Fund seeks to achieve positive environmental impact by investing primarily in companies that are leading the way to a zero-carbon economy and have either an approved SBTi emissions reduction plan, an ambitious carbon reduction plan, are working towards a carbon reduction plan or offer solutions that contribute to a zero-carbon economy. Sustainability is seen as a key "locomotive for change" in investment decision making. Engagement is an important part of the investment process. The External investment Manager engages with investee companies on various ESG topics directly, in collaboration with its peers, and through initiatives. EdenTree engages in long-term as well as in shorter-term tactical engagements.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|--------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies non-compliant with SFDR Sustainable Investments mandatory norms and conventions | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |

ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | |
|---|-----------------------|
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >5% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >5% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis as defined by the ESG/responsibility review of the External investment Manager. All investments undergo an ESG/Responsibility review, which considers six areas of business risk (i.e., business ethics, community, corporate governance, employment and labour, environment and climate change, human rights). The external investment manager seeks to see positive direction in all six ESG areas over a 3–5-year period. All companies failing in meeting the External Investment Manager’s ESG/responsibility review are excluded from the investment universe.
- Sustainable investment eligibility criteria (the below criteria may not be cumulative):
 - Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed Science Based Target (SBT)", or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets.
 - Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
 - Having a net positive aggregated Overall SDG Score by reference to the Sustainable Development Goals. The criterion is sourced from the external data provider ISS. This criterion assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer’s product portfolio on the achievement of sustainability objectives. For corporate issuers the SDG

ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Solutions Score considers only the most distinct objectives scores, i.e., the highest positive and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solutions Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.

- Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of these criteria or (ii) a differentiated view of the company's impact assessment leveraging the External Investment Manager's proprietary methodology.

● **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |

ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | | | |
|-----------------------|-----------------------------------|----------------------|--|
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The external investment manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. This external investment manager assesses prospective investments for issues relating but not limited to ownership and control, board structure, board diversity, pay practices, accounting and tax practices, political and lobbying practices, and stakeholder engagement.

The external investment manager reviews policies, such as codes of conduct and anti-bribery and corruption policies, as well as compliance infrastructure to assess governance practices. The external investment manager examines the history and pattern of corporate behaviour going back five years and assesses remediation of governance controversies.



What is the asset allocation and the minimum share of sustainable investments?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the sustainable investment process in place, hence in investments that are defined as sustainable (#1 Sustainable). The external investment manager’s proprietary sustainable analysis covers 100% of the “#1 Sustainable” investments. “#1 Sustainable” investments include a minimum of 50% assets with environmental objectives and 25% with social objectives. Investments with environmental objectives are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy.

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Not Sustainable). “#2 Not Sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging purpose as a technique of portfolio management efficiency. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.

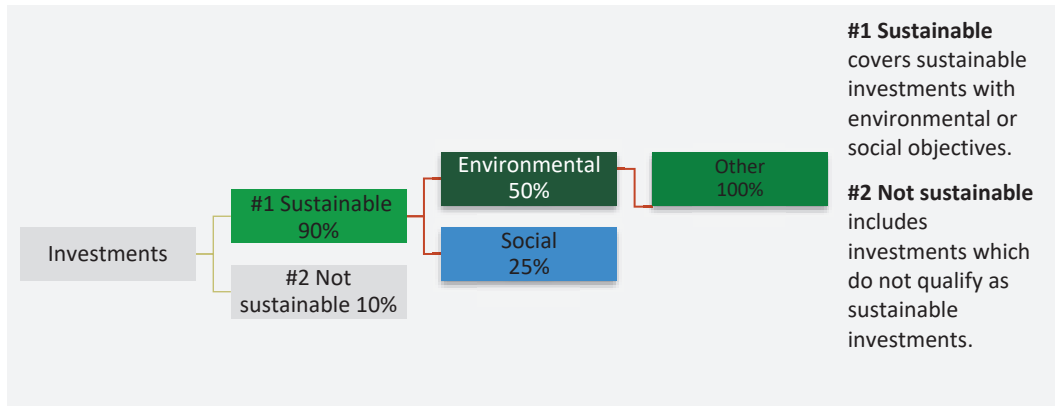
Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee



#1 Sustainable covers sustainable investments with environmental or social objectives.

#2 Not sustainable includes investments which do not qualify as sustainable investments.

● **How does the use of derivatives attain the sustainable investment objective?**

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund's sustainable investments with an environmental objective are not aligned with the EU taxonomy (i.e. 0%) as the investments with an environmental objective are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU taxonomy.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

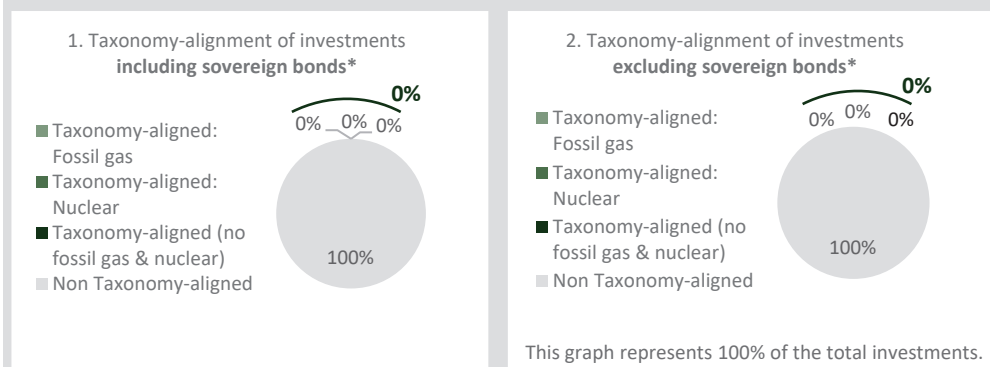
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy is 100%. The Sub-Fund commits to make a minimum of 50% sustainable investments with an environmental objective not aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund commits to make a 25% minimum share of sustainable investments with a social objective.



What investments are included under “#2 Not sustainable”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Not Sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging purpose as a technique of portfolio management efficiency. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.

ABN AMRO Funds EdenTree European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to meet the sustainable investment objective?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How does the reference benchmark take into account sustainability factors in a way that is continuously aligned with the sustainable investment objective?***
Not Applicable
- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***
Not Applicable
- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***
Not Applicable
- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***
Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- **ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:**
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- **Documents of the Sub-Fund:**
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities

Legal entity identifier:

549300THMKO6BNKMKF82

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary.

ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?

Not Applicable

How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

Not Applicable

How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|--|--------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |

ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | |
|---|-----------------------|
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU)2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

The delegated external investment managers selected by the Management Company are committed to apply a selectivity rate of at least 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

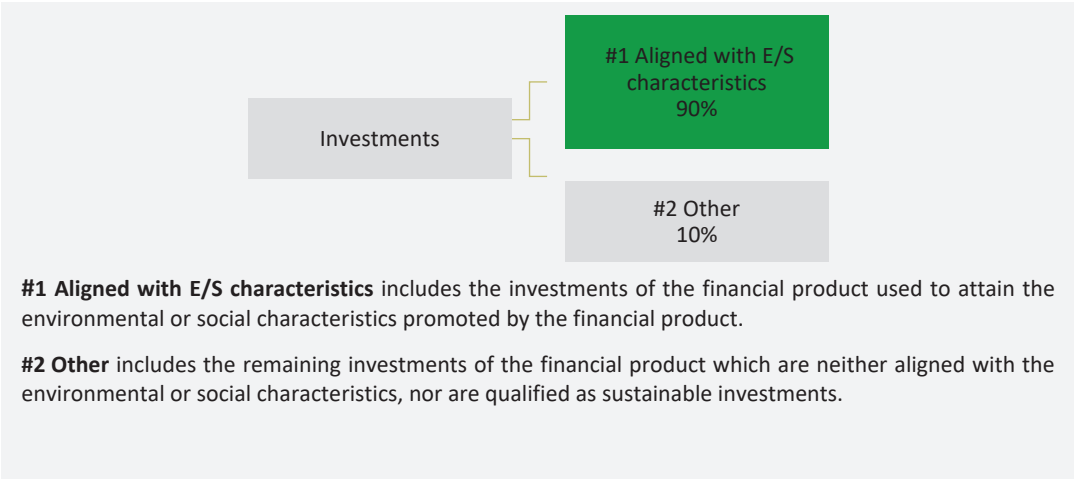
Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

Yes:

In fossil gas In nuclear energy

No

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules.

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

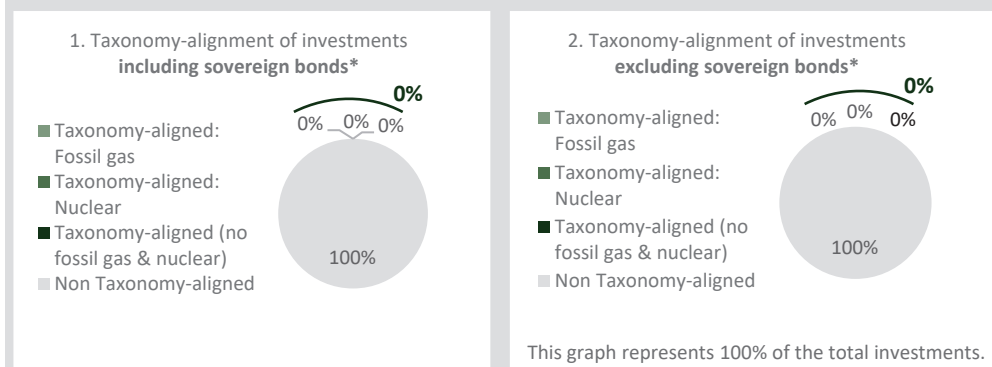
Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

ABN AMRO Funds Emerging Markets ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Global ESG Equities

Legal entity identifier:

5493004T2JKIP24WRQ57

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Global ESG Equities (the “Sub-Fund”). ESG integration is defined as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are leading in ESG best-practice.

ABN AMRO Funds Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

ABN AMRO Funds Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?

Not Applicable

How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

Not Applicable

How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

To select eligible securities, the Management Company performs both a financial and non-financial analysis, using ESG criteria in combination with exclusions filters. The Sub-Fund will be composed of issuers that are leading in ESG best-practice. The eligible universe is determined by the combination of exclusion filters and selectivity approach based on ESG data from Sustainalytics as set out below.

- Exclusion filters: the purpose of these filters is to exclude companies and activities that might have a negative effect on society and environment or human rights (activities and norm-based exclusions). On this basis are excluded certain controversial activities such as but not limited to weapons production, tobacco producers and sellers, GMOs, gambling, adult entertainment, cannabis for recreational purpose, arctic drilling, shale gas, oil sands, coal mining, fur and specialty leather, etc. (subject to certain revenue thresholds). Based on international norms violation, companies involved in serious human rights injuries and environmental damage are also excluded.
- ESG best-in-class approach or positive screening: the Management Company identifies companies that manage their ESG risk better than their peer group within the Top 50th percentile of the sub-industry peer group (Sustainalytics' assessment of a company's ESG Risk Score relative to a Sustainalytics' subindustry, expressed as a percentage rank, with 1% representing the company with the lowest ESG Risk Score and 100% the company with the highest ESG Risk Score in the subindustry). Moreover, the Sub-Fund will not invest in companies whose controversy score is above certain thresholds: level 4 and 5 are not allowed (within a scale from 0 to 5 where: 0 is No controversy, 1 is Low, 2 is Moderate, 3 is Significant, 4 is High, and 5 is Severe).

The Management Company then performs further analysis to consider the valuation of these companies and the appropriate time to purchase in consideration of the Fund's financial objective.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|--|--------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |

ABN AMRO Funds Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | |
|---|-----------------------|
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The companies with the top 50% ESG risk scores in their sub-industry peer groups and with a controversy score below 4 are considered for inclusion in the portfolio.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

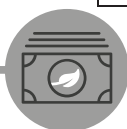
Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

ABN AMRO Funds Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

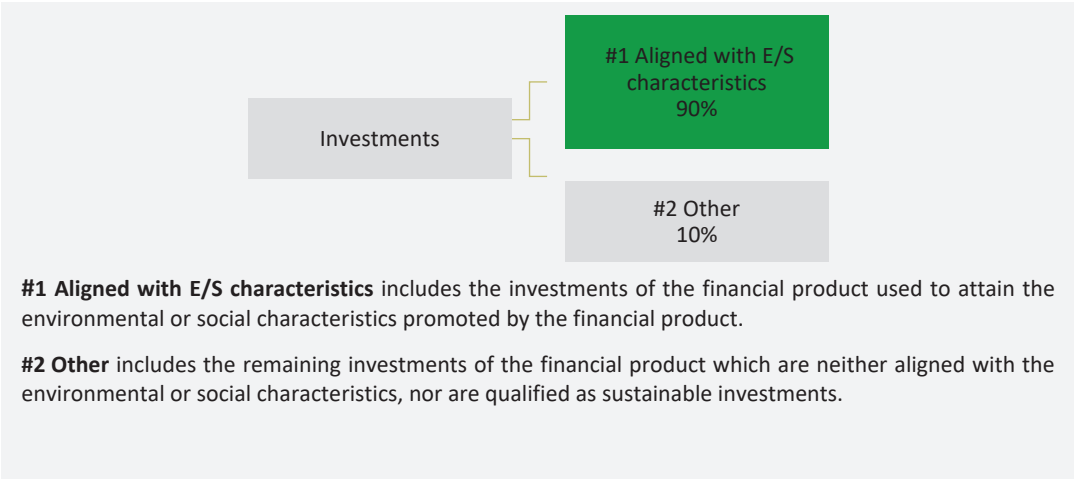
Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

ABN AMRO Funds Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

Yes:

In fossil gas In nuclear energy

No

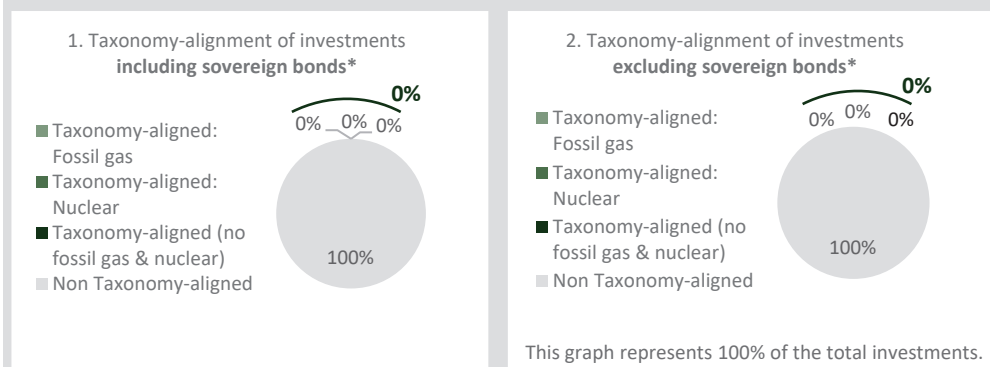
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

ABN AMRO Funds Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

Legal entity identifier:

549300LCUAZBZWYABN92

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Manager must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall sustainability strengths going from the

ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights and labour standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✗ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, it strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

The External Investment Manager believes that the transition to a more sustainable global economy provides a helpful backdrop to construct high conviction, low turnover equity portfolios that are well positioned to achieve long term capital growth. The Sub-Fund seeks to invest in companies with sustainable competitive advantages that are positioned to achieve high or improving returns over the investment horizon.

The External Investment Manager combines its “sustainability lens” and its “systematic ESG rating” analysis to select companies with long-term opportunities in sectors that are less exposed to disruption and risk.

First, the “sustainability lens” helps to assess ESG risks as well as opportunities by identifying sub-sectors well positioned for the transition to a more sustainable economy as well as those that present risks within this transition.

Sub-industries are measured against 9 risks:

- Company
 - o Health & Safety Vulnerability
 - o Labour Constraints
 - o Pollution & Waste Externalities
- Stakeholders
 - o Supply Chain Dependency
 - o Product Liabilities (including Cybersecurity)
 - o Bribery & Corruption
- Wider Landscape
 - o Natural Resources & Biodiversity
 - o Climate Change
 - o Anti-trust Regulations

The “sustainability lens” analysis results in ranking companies on a 3 scale level (i.e. high, neutral and low).

Then, the External Investment Manager’s “systematic ESG Rating” which is used in this Sub-Fund combines multiple sources of third-party ESG data with original research and analysis. This systematic scoring system provides a proprietary ranking of companies’ ESG performance versus sector peers, scoring Russell 1000 companies on a scale of 0-10 .

This scoring includes consideration of

- Over 180 key ESG indicators
- Original security research
- Impax Gender indicator
- Impax Carbon Intensity indicator
- How exposed is the company to material ESG risks?
- How can the company take advantage of ESG opportunities?
- Assigns weights for indicators, tailored by industry
- ESG momentum adjustment – taking into account progress or regression in a company’s ESG profile

ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ESG controversy scoring adjustment

Lastly, the External Investment Manager assesses the ideas generated by the Sustainability Lens and the Systematic ESG score model using the External Investment Manager’s 10- Step analysis. This 10-Step analysis includes an in-depth ESG analysis and covers

- Environmental, Social and Governance (ESG) processes, performance, and policies in place and the level of disclosure of these.
- Structure and effectiveness of the Board.
- Shareholder friendliness and the protection of shareholder rights.
- Ownership structure and control issues.
- Compensation and incentive structures, alignment with shareholder long term interests and level of disclosure.
- Corporate behaviour, reputation, and integrity.

Following completion of the analysis, each company is categorized by the External Investment Manager’s dedicated ESG analyst into one of the following:

- Excellent
- Good
- Average
- Fair
- Excluded

Companies categorized as ‘Excluded’ are not eligible for investment, while those categorized as ‘Fair’ have a cap for allowed weighting within the portfolio.

Methodological limitations can be assessed in terms of nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company’s exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|--|--------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact’s Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |

ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | |
|---|-----------------------|
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will exclude fossil fuel (i.e., thermal coal, oil and gas) related investments as follows: exploration & production and refining & processing:
 - Companies with >0% revenue or profits (defined as EBIT, EBITA or EBITDA) derived from direct fossil fuel activities identified above (i.e., exploration & production and refining & processing) will be excluded from Sub-Fund's portfolio.
 - Companies with >5% revenue or profits (defined as EBIT, EBITA or EBITDA) derived from direct storage and distribution activities will ordinarily be excluded from the Sub-Fund's portfolio, although companies may be included in the portfolio if a company has established itself as a leader in the transition to a zero-emissions energy economy with reduction targets, including GHG Emissions - Scope 1, GHG Emissions - Scope 2, and GHG Emissions - Scope 3, that are compatible with the Paris Agreement's target of limiting future warming to 2°C, and has agreed to publicly report on progress.
 - Companies with >5% revenue or profits (defined as EBIT, EBITA or EBITDA) derived from the above power generation sector will ordinarily be excluded from the Sub-Fund's portfolio, although companies may be included in the portfolio if a company has established itself as a leader in the transition to a zero-emissions energy economy with reduction targets, including Scope 1, Scope 2, and Scope 3, compatible with the Paris Agreement's target of limiting future warming to 2°C, and has agreed to publicly report on progress.
- Exclusion of the companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. The External Investment Manager considers for inclusion in the portfolio companies which score 5 or above, as ranked by the external investment manager ESG Rating. ESG laggards (score of <2.5) are excluded from the universe.

ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

- **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

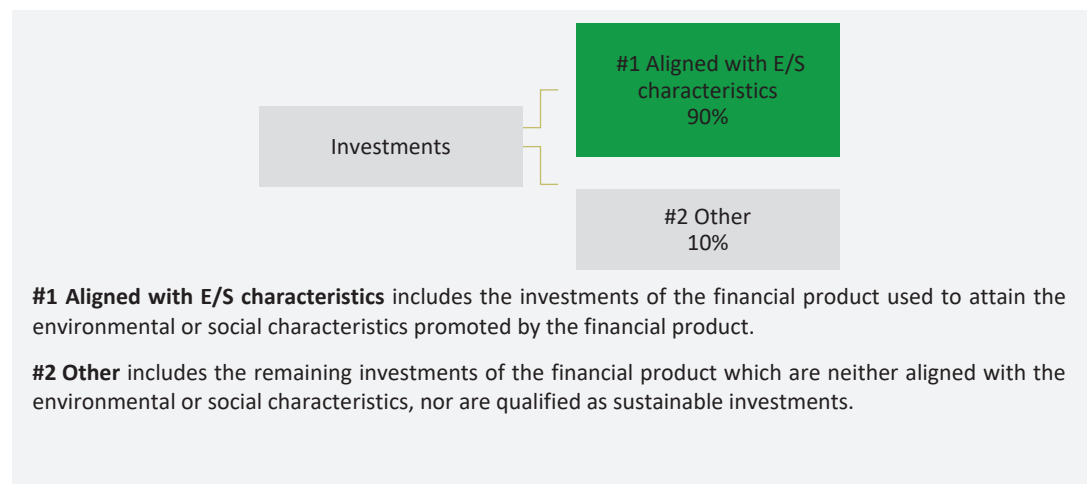
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

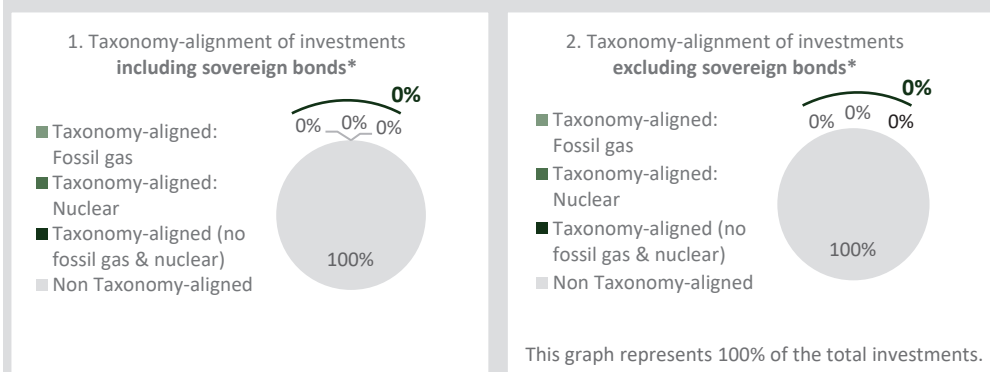
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Impax US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>

- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds

Legal entity identifier:

549300GRK0RJWQG5TW54

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

Not Applicable

How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

The External Investment Manager's approach starts by defining an ESG optimised investment universe, whereby issuers deemed unsustainable (as further described) are excluded. At this stage, the bottom 40% of issuers within the global universe are being removed. Within the optimised universe, the External Investment Manager selects securities based on financial criteria, as well as ESG criteria. Each issuer is evaluated through fundamental credit analysis and receives the External Investment Manager's own proprietary risk centric ESG ratings. Issuers with an ESG rating of 3.6 or worse fall within the 40th percentile threshold (ratings are from 1 to 5, 1 being the best and 5 being the worst score). Any issuers with ratings worse than 3.6 (means: over 3.6) will need to have a positive ESG momentum score (explained below), indicating that the company is on an improving ESG trajectory, to be considered for investment.

The ESG analysis is a quantitative framework that effectively integrates the External Investment Manager's analysts' research, and supplemented with data from multiple third-party data providers, generates an ESG rating and momentum signal for a wide range of entities. The External Investment Manager incorporates raw ESG data from four full ESG datasets namely: MSCI, Sustainalytics, VigeoEiris, and CDP climate change & water metrics. The External Investment Manager also uses the Bloomberg legal entities references for credit risk datasets to map the ESG records to all issuers within a credit risk tree. Raw data from these data providers is then mapped and assigned global company identifiers and ultimate parent identifiers before being added to the External Investment Manager ESG database. Each metric that contributes to an issuer's ESG rating has two key elements (i) a score - evaluating an issuer's performance in that metric (ii) a weight -evaluating the materiality of the metric to the issuer.

Both datasets are then mapped to one or more ESG 'pillars' as set out below; these have different weights depending on the issuer's industry. To generate a weight and a score at key-issue level, the External Investment Manager combines inputs from the credit analysts together with third-party averages. The analysts' views on the materiality of key issues facing each industry group are merged with views of the data providers, and the values are averaged. To ensure the External Investment Manager ESG ratings are based on good data coverage, the External Investment Manager includes only records which (i) have data under each E, S and G pillar, which are based on (ii) five distinct data points and (iii) have more than five distinct data provider fields. This scoring methodology produces two separate ratings for every issuer: an overall ESG rating and a momentum signal. The overall ESG rating is designed to indicate an issuer's performance relative to its peers. The External Investment Manager calculates each issuer's percentile based on the raw ESG ratings within each Global Industry Classification Standard (GICS) industry group and assign the final ESG rating (between 1 and 5, where 1 is the best score and 5 the worst). The momentum signal considers the most recent five years of headline ESG scores and determines an average year-on-year change, weighted towards the most recent data. Based on this data, a momentum score from -2 to 2 is assigned.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. The Sub-Fund focuses on companies which score 3.6 or below, as ranked by the External investment Manager (the lower score, the better). Companies which score over 3.6 can be invested if the ESG momentum score is positive as assessed by the external Investment Manager, indicating that the company is on an improving ESG trajectory.

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

- **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

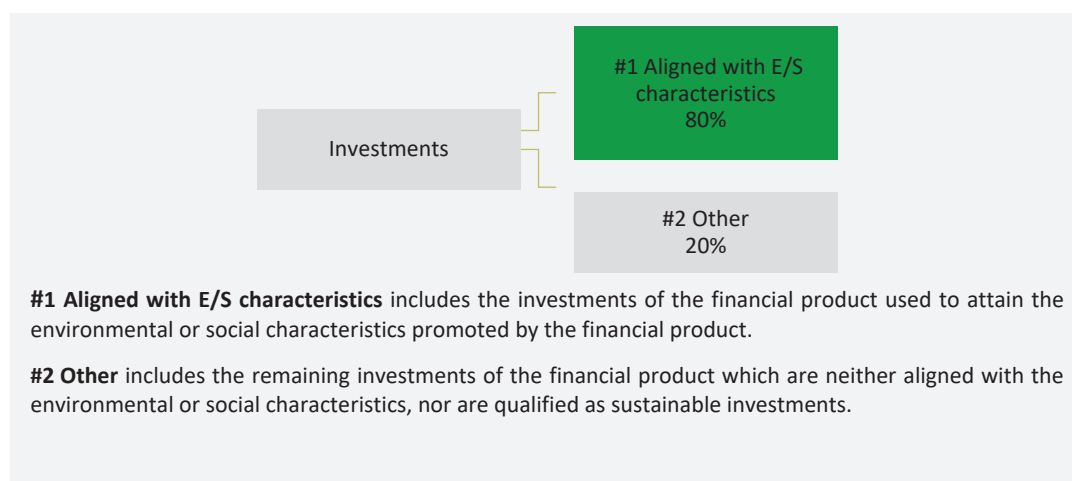
What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds

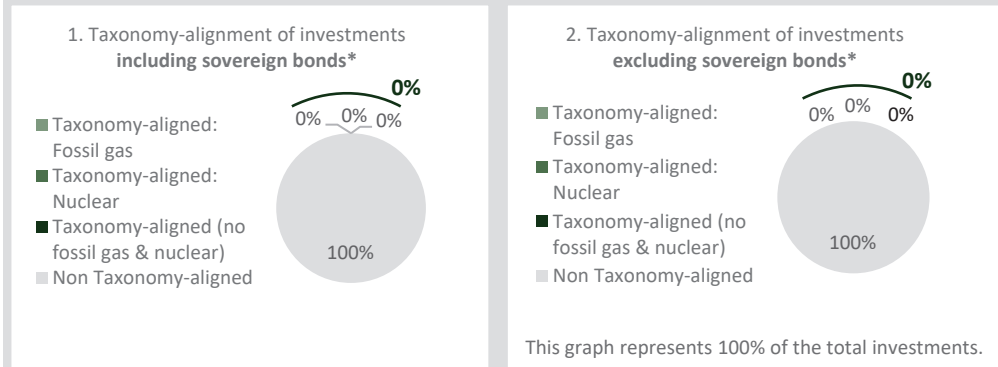
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged

Legal entity identifier:

549300SJ3V951NBLB873

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

Not Applicable

How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

The External Investment Manager's approach starts by defining an ESG optimised investment universe, whereby issuers deemed unsustainable (as further described) are excluded. At this stage, the bottom 40% of issuers within the global universe are being removed. Within the optimised universe, the External Investment Manager selects securities based on financial criteria, as well as ESG criteria. Each issuer is evaluated through fundamental credit analysis and receives the External Investment Manager's own proprietary risk centric ESG ratings. Issuers with an ESG rating of 3.6 or worse fall within the 40th percentile threshold (ratings are from 1 to 5, 1 being the best and 5 being the worst score). Any issuers with ratings worse than 3.6 (means: over 3.6) will need to have a positive ESG momentum score (explained below), indicating that the company is on an improving ESG trajectory, to be considered for investment.

The ESG analysis is a quantitative framework that effectively integrates the External Investment Manager's analysts' research, and supplemented with data from multiple third-party data providers, generates an ESG rating and momentum signal for a wide range of entities. The External Investment Manager incorporates raw ESG data from four full ESG datasets namely: MSCI, Sustainalytics, VigeoEiris, and CDP climate change & water metrics. The External Investment Manager also uses the Bloomberg legal entities references for credit risk datasets to map the ESG records to all issuers within a credit risk tree. Raw data from these data providers is then mapped and assigned global company identifiers and ultimate parent identifiers before being added to the External Investment Manager ESG database. Each metric that contributes to an issuer's ESG rating has two key elements (i) a score - evaluating an issuer's performance in that metric (ii) a weight -evaluating the materiality of the metric to the issuer.

Both datasets are then mapped to one or more ESG 'pillars' as set out below; these have different weights depending on the issuer's industry. To generate a weight and a score at key-issue level, the External Investment Manager combines inputs from the credit analysts together with third-party averages. The analysts' views on the materiality of key issues facing each industry group are merged with views of the data providers, and the values are averaged. To ensure the External Investment Manager ESG ratings are based on good data coverage, the External Investment Manager includes only records which (i) have data under each E, S and G pillar, which are based on (ii) five distinct data points and (iii) have more than five distinct data provider fields. This scoring methodology produces two separate ratings for every issuer: an overall ESG rating and a momentum signal. The overall ESG rating is designed to indicate an issuer's performance relative to its peers. The External Investment Manager calculates each issuer's percentile based on the raw ESG ratings within each Global Industry Classification Standard (GICS) industry group and assign the final ESG rating (between 1 and 5, where 1 is the best score and 5 the worst). The momentum signal considers the most recent five years of headline ESG scores and determines an average year-on-year change, weighted towards the most recent data. Based on this data, a momentum score from -2 to 2 is assigned.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

For information, the Sub-Fund will aim to lower the duration by an equivalent of the duration of its Reference Portfolio using listed derivatives.

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. The Sub-Fund focuses on companies which score 3.6 or below, as ranked by the External investment Manager (the lower score, the better). Companies which score over 3.6 can be invested if the ESG momentum score is positive as assessed by the external Investment Manager, indicating that the company is on an improving ESG trajectory.

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

- **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

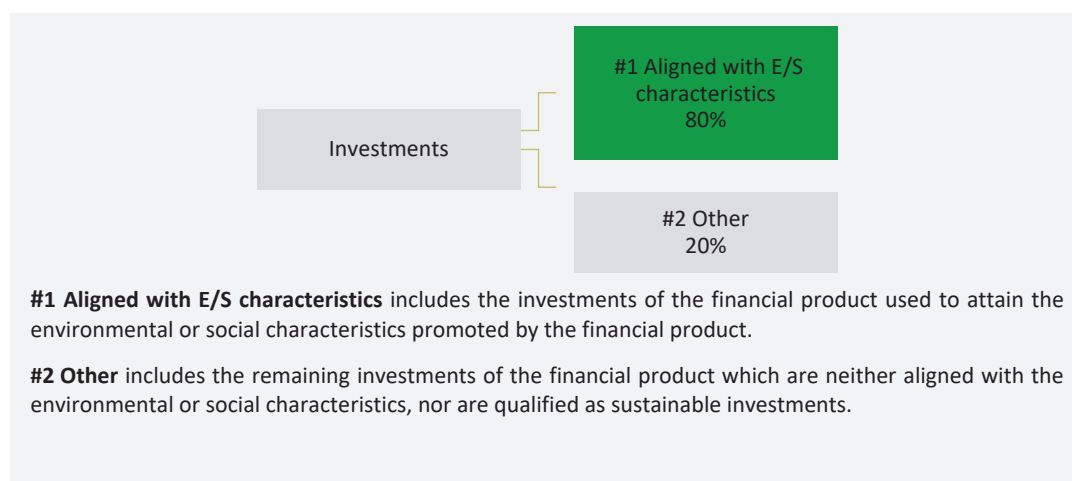
What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged

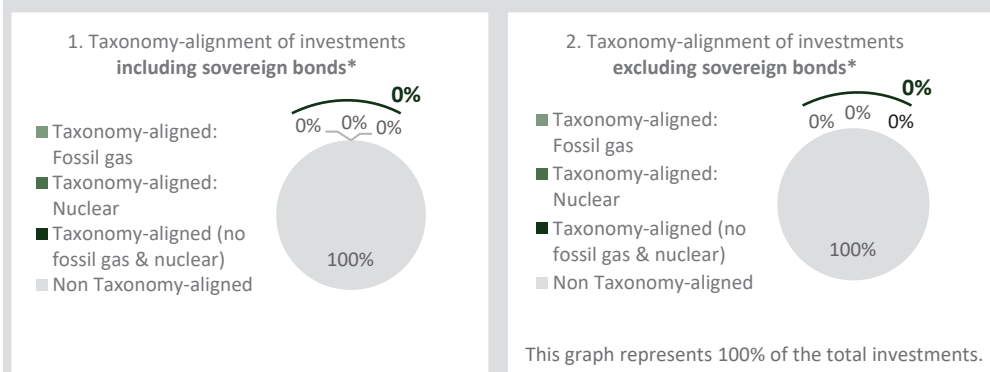
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Insight Euro ESG Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- **ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:**
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- **Documents of the Sub-Fund:**
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Legal entity identifier:

63670019066TV61K1P05

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities (the "Sub-Fund"). The External Investment Manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the "Management Company") ESG responsibility criteria. The External Investment Manager must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk mitigation management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.

- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

— ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

— ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund aims to provide medium term capital growth with a diversified and actively managed portfolio of Asia Pacific market equities. The Sub-Fund is actively managed through a fundamental and bottom-up stock selection process while seeking to identify high quality companies with superior and sustainable growth potential. The External Investment Manager integrates ESG aspects to identify companies with strong or improving sustainability characteristics and that are leading in ESG practices.

In-depth fundamental research is conducted on companies in the Pacific Developed region by research analysts. The External Investment Manager in-depth analyses are captured in the Strategic Classification. The objective of the Strategic Classification is to answer a simple question: "Is this a business we want to own?". The Strategic Classification takes an exhaustive look at:

- **Economics:** In order to understand economic returns, the External Investment Manager needs to consider all of the factors that influence the amount of capital needed to run a business, the profits it makes by employing this capital, and the amount of capital that can be re-invested. These factors can be external to the company (macro and industry), or specific to it (company and management).
- **Duration:** A company's ability to sustain returns depends on a wide variety of factors: to have confidence in a company's duration, the External Investment Manager needs to consider the potential impact on the business of several risk factors, including macro, industry and company factors, as well as management choices.
- **Governance:** Many different factors influence the External Investment Manager view of governance. They can be approached in two ways (i) by source (macro/industry/company/management) and (ii) by cause (competence and motives).

Following the analysis of these variables, the analyst will assign one of the four Strategic Classifications to a company (i) Premium (ii) Quality (iii) Trading (iv) Structurally Challenged. The strategy has a clear preference for Premium and Quality companies. The analysts also complete the EMAP Checklist and Materiality Framework for every company to assess the

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

risks associated with the business. The EMAP Checklist is a near-100 question survey completed for every company covered, with the primary goal of identifying the key risks associated with the company. ESG considerations are formally addressed through 40 question ESG Checklist. The 40 questions are a globally consistent subset of the near-100 question survey. The checklist includes both negative and positive questions, as well as a severity assessment. The EMAP Checklist is not a “pass/fail” exercise. Rather, it is a tool to inform discussions between portfolio managers and analysts and an important driver behind the engagement with the companies covered. The overall assessment influences the Strategic Classifications. The Materiality Framework is a proprietary tool used to score companies on the ESG issues that are relevant to the sub-industry in which they operate. Analysts consider the five most financially material ESG risks (as identified by the analysts) in over 50 sub-industries and companies are rated 1 to 5 on each of those five risk factors. For example, issues around pollution would be material for a commodity company but immaterial to a software company (where instead issues like data protection would be more material). The 1-5 scoring system reflects a desire to differentiate between leaders and laggards, and to do so in a way which emphasizes judgement over data gathering. The Materiality Framework serves as a roadmap for more specific engagement with companies.

Having understood the opportunity and risks around a company, the research analysts then value that opportunity through a valuation framework analysis.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company’s exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact’s Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | |
|---|------|
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Exclusion of the companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. The External Investment Manager excludes the worst quintile of stocks based on their internal ESG score driven by the EMAP Checklist, a nearly 100-question sustainability checklist, to filter out the “worst offenders” not previously excluded. The companies are ranked by how many red flags they have on the EMAP Checklist and then the bottom quintile is excluded. The higher the number of red flags the worse the ESG score

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|--|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | | | |
|-----------------------|--|------------------------------------|---|
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The External Investment Manager attempts to outline a complete set of considerations on Governance in the EMAP Checklist for every company under coverage. In the checklist of questions, Governance is analysed through an appraisal of management in specific areas of activity: (i) Attitudes & skill set (ii) Track record & consistency (iii) Financing the business (iv) Financial transparency & dividends (v) Short termism & motives (vi) Ownership Factors. Governance is covered in detail in the Strategic Classification of a company. In this in-depth analysis the External Investment Manager looks to appraise whether the company's returns will accrue to shareholders in full, or be impaired by poor governance. Finally, governance considerations are also covered in the Materiality Framework, with the focus varying depending on which issues are most financially material to the sub-industry.



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

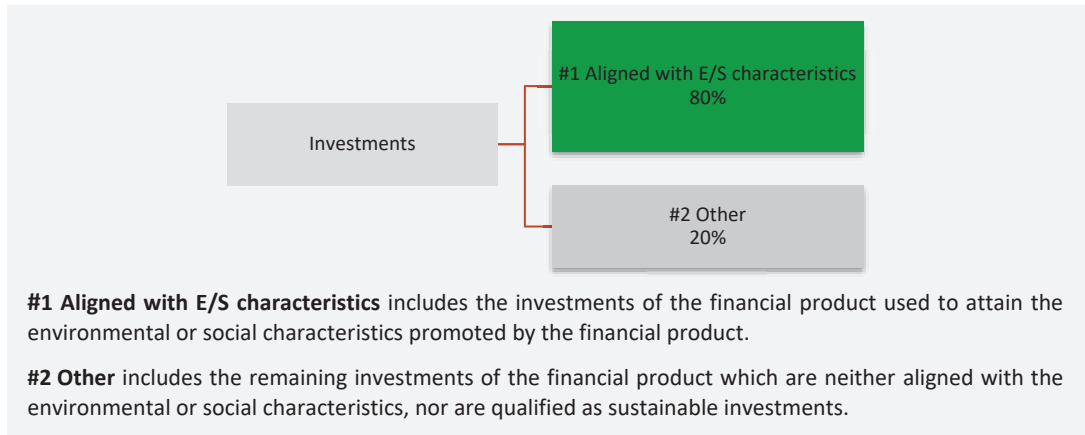
Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

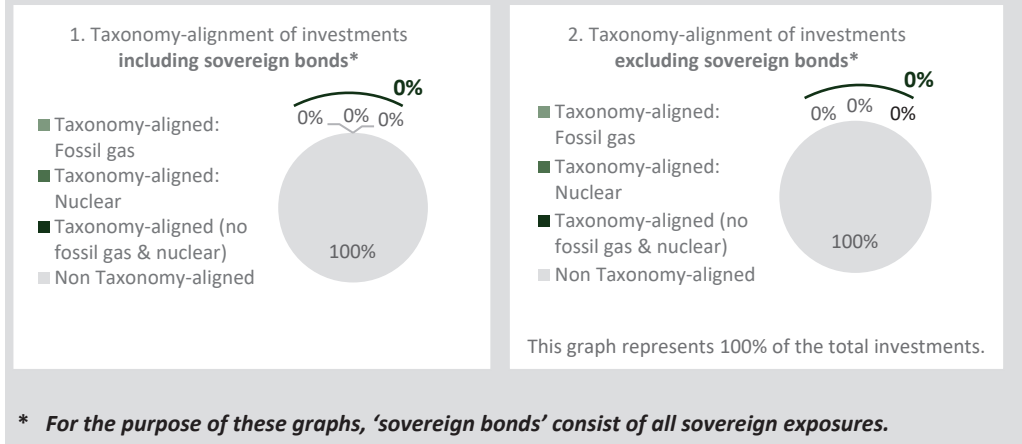
- Yes:
- In fossil gas
 - In nuclear energy
- No

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***
Not Applicable
- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***
Not Applicable
- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***
Not Applicable
- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***
Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html)
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- [Documents of the Sub-Fund:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html)
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds

Legal entity identifier:

5493003UDGYSKOEU0584

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall sustainability strengths going from the

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria.

The External Investment Manager's approach is based on three pillars:

- exclusion & avoidance,
- integration: in the investment process the external investment manager assesses the ESG profile of a company. The external investment manager takes into account material risks in a given industry in combination with the company's respective risk exposure, practices and disclosure. Furthermore, the external investment manager looks into the company's exposure to past controversies and future ESG opportunities. A low score on ESG criteria can result in the demand for an additional premium on the company's bonds and/or initiation of an engagement with the issuer. If ESG risks are deemed too severe, an investment in the company will be avoided and/or existing holdings will be sold
- Engagement: As active long-term investors, the external investment manager performs comprehensive engagements with portfolio companies with the objective to unlock value and reduce risk. The external investment manager engagement process defines clear objectives of which the progress and result is tracked and well documented. If at any stage the company refuses to cooperate, divestment has to be considered.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|--|--------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >35% |
| Thermal Coal Extraction | >10% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Exclusion of the companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. The External Investment Manager considers for

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

inclusion in the portfolio companies which score CCC or above and taking the external data provider MSCI ESG.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | | | |
|-----------------------|-----------------------------------|----------------------|--|
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The External Investment Manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. The External Investment Manager utilises its UN Global Compact Exclusion process and resulting list. The Stewardship and Sustainability team and UN Global Compact Committee of the external investment manager (including representatives from all asset classes) are responsible for the ongoing monitoring and oversight of said exclusion list, and assess individual companies and cases via 7 key principles in order to determine status. These are: pattern of behaviour, legitimacy, assurance, engagement, duration and extent of behaviour. As inputs to the research process, the external investment manager uses third-party ESG data vendors alongside company disclosures and news.



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

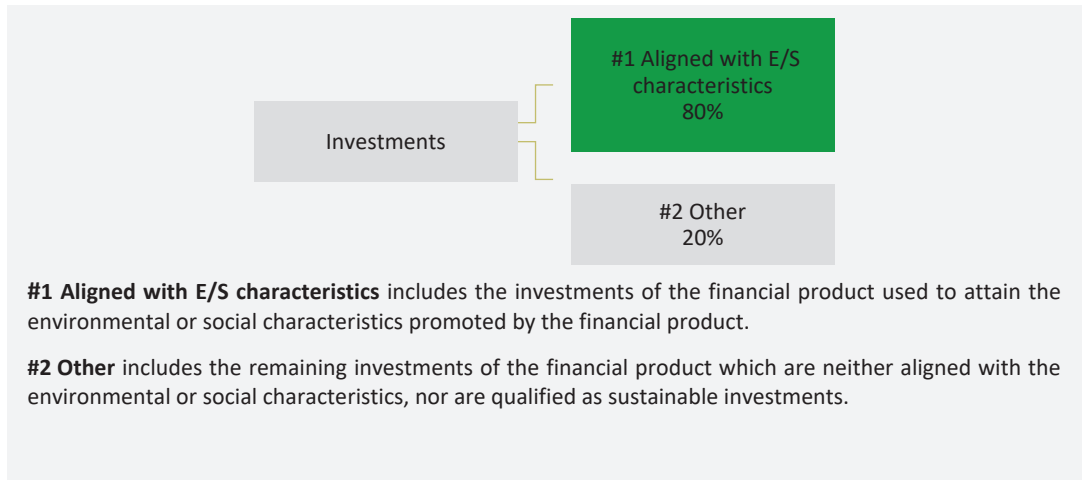
Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy²?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

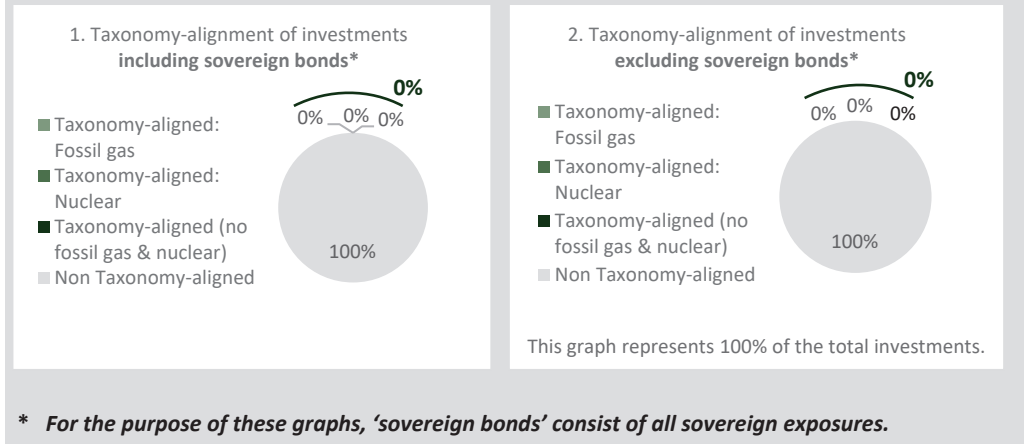
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

² Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

ABN AMRO Funds JPMorgan Asia Pacific ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***
Not Applicable
- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***
Not Applicable
- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***
Not Applicable
- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***
Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- *ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:*
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abnamro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- *Documents of the Sub-Fund:*
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Legal entity identifier:

5493009C88PY6WDG4J06

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall sustainability strengths going from the

ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria.

The External Investment Manager's approach is based on three pillars:

- exclusion & avoidance,
- integration: in the investment process the external investment manager assesses the ESG profile of a company. The external investment manager takes into account material risks in a given industry in combination with the company's respective risk exposure, practices and disclosure. Furthermore, the external investment manager looks into the company's exposure to past controversies and future ESG opportunities. A low score on ESG criteria can result in the demand for an additional premium on the company's bonds and/or initiation of an engagement with the issuer. If ESG risks are deemed too severe, an investment in the company will be avoided and/or existing holdings will be sold
- Engagement: As active long-term investors, the external investment manager performs comprehensive engagements with portfolio companies with the objective to unlock value and reduce risk. The external investment manager engagement process defines clear objectives of which the progress and result is tracked and well documented. If at any stage the company refuses to cooperate, divestment has to be considered.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

For information, the Sub-Fund will aim to lower the duration by an equivalent of the duration of its Reference Portfolio using listed derivatives.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|--|--------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >35% |
| Thermal Coal Extraction | >10% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Exclusion of the companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. The External Investment Manager considers for inclusion in the portfolio companies which score CCC or above and taking the external data provider MSCI ESG.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |

ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | | | |
|-----------------------|-----------------------------------|----------------------|--|
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The External Investment Manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. The External Investment Manager utilises its UN Global Compact Exclusion process and resulting list. The Stewardship and Sustainability team and UN Global Compact Committee of the external investment manager (including representatives from all asset classes) are responsible for the ongoing monitoring and oversight of said exclusion list, and assess individual companies and cases via 7 key principles in order to determine status. These are: pattern of behaviour, legitimacy, assurance, engagement, duration and extent of behaviour. As inputs to the research process, the external investment manager uses third-party ESG data vendors alongside company disclosures and news.



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics)).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

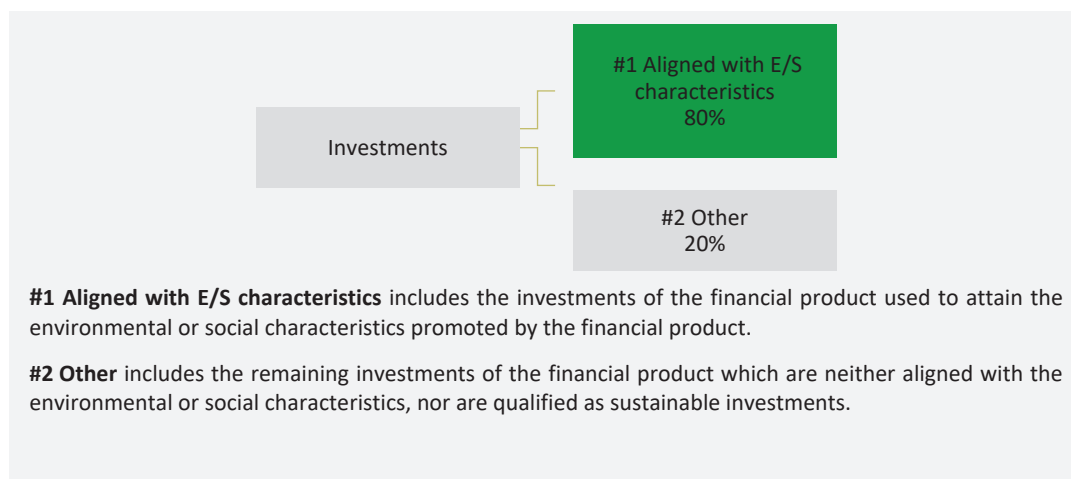
Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



#1 Aligned with E/S characteristics includes the investments of the financial product used to attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product.

#2 Other includes the remaining investments of the financial product which are neither aligned with the environmental or social characteristics, nor are qualified as sustainable investments.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

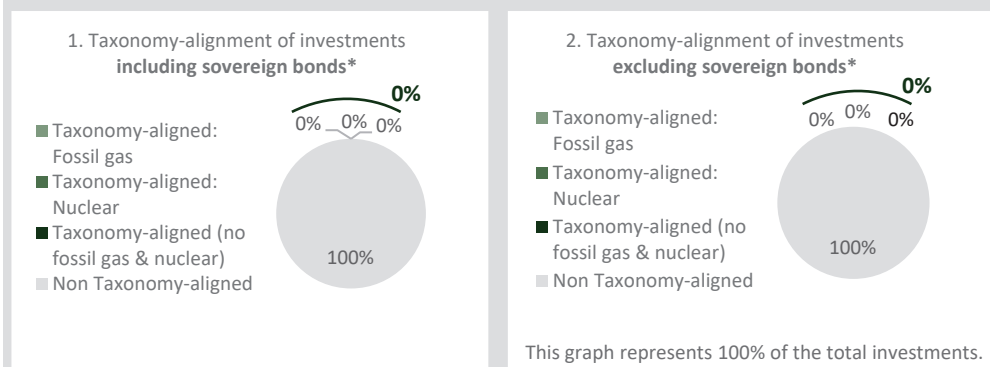
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

ABN AMRO Funds Kempen Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Legal entity identifier:

549300OKY4JTQC0B2J87

Sustainable investment objective

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Yes | <input type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="checkbox"/> No |
|--|--|
| <p><input checked="" type="checkbox"/> It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: 25%</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy <input checked="" type="checkbox"/> in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy <p><input checked="" type="checkbox"/> It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: 25%</p> | <p><input type="checkbox"/> It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy <input type="checkbox"/> with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy <input type="checkbox"/> with a social objective <p><input type="checkbox"/> It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments</p> |



What is the sustainable investment objective of this financial product?

ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities (“the Sub-Fund) follows a multi-thematic sustainable investment strategy. The portfolio will be composed of issuers which are positively exposed to three long-term sustainable themes such as (i) better resource efficiency, (ii) improved health as well as (iii) greater safety and resilience.

The environmental sustainable investment objective of the Sub-Fund is to invest in businesses which support the goal of net zero greenhouse gas emissions by 2050, in line with the external investment manager’s Net-Zero Asset Managers Initiative (NZAM) commitment and the goals of the Paris Agreement. The practical working assumption is based on the Intergovernmental Panel on Climate Change (IPCC) analysis conclusion that to meet the Paris Agreement (to stay below 2 degrees centigrade ideally 1.5 degrees centigrade) of global warming we must reach net zero emissions by 2050. To achieve this

ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

the fund will reduce absolute emissions by 50% between 2020 and 2030, and a further 50% between 2030 and 2040 and a further 50% by 2050. This includes front-loaded absolute emission reduction targets (25% reduction by 2025 versus 2019 and 50% by 2030), as well as discouraging use of offsets in the investment manager's engagement with companies. This is measured through several different metrics to capture the multi-faceted aim of investing in companies consistent with climate change goals. This includes exposure to companies reducing emissions (solution providers), the Sub-Fund's exposure to companies, carbon foot-printing that is consistent with the investment manager's NZAMI commitment. The approach is in line with the expectations of the Commission Delegated Regulation (EU) 2020/1818 relating to GHG scopes, calculation methodologies and exclusions. In addition, as part of its social sustainable investment objective, the Sub-Fund invests in companies contributing positively to social solutions.

To define the sustainable investment universe, a "pass-fail" approach is used using a set of criteria. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the sustainable objectives followed by the Sub-Fund.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The analysis of certain sustainability indicators is systematically integrated into the investment decision making process. The attainment of the sustainable investment objectives is assessed by investing in securities financing economic activities that substantially contribute to the environmental and/or social objectives mentioned above. To define the sustainable investment universe, a "pass-fail" approach using a set of criteria. No other criteria than the ones mentioned below are used to define the sustainable investment nature of an investment. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe.

To be eligible to the investment universe, we use the below criteria:

- Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed Science Based Target (SBT)", or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets.
- Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
- Having a net positive aggregated overall SDG by reference to the Sustainable Development Goals. This criterion, sourced from the external data provider ISS, assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer's product portfolio on the achievement of sustainability objectives. For corporate issuers the SDG Solutions Score considers only the most distinct objectives scores, i.e., the highest positive and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The

Sustainability indicators measure how the sustainable objectives of this financial product are attained.

ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

SDG Solutions Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.

- Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of these criteria or (ii) a differentiated view of the company's impact assessment leveraging the External Investment Manager's proprietary methodology.

How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?

The "Do No Significant Harm" (DNSH) principle is complied by taking into account adverse impacts indicators listed in the Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022. The Sub-Fund takes into consideration (for some of them using proxies) all the mandatory adverse impact indicators listed in Table 1 of Annex 1 that are applicable to investee companies.

In addition, the Sub-Fund takes into consideration PAI No. 4 in Table 2 of Annex 2, applicable to investee companies, relating to investments in companies without carbon reduction initiatives. The Sub-Fund also takes into consideration PAI No. 15 of Table 3 of Annex 1, applicable to investee companies, relating to the lack of anti-corruption and anti-bribery policies.

How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

The Sub-Fund considers adverse impacts of its investments on society and the environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusions of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 in portfolio management decisions and exclusions, using proxy indicators.

- the exposure to controversial weapons (i.e., PAI 14)

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator "investing in companies without carbon emission reduction initiatives" (i.e., PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the indicator "lack of anti-corruption and anti-bribery policies" (i.e. PAI 15) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

The Sub-Fund's sustainable investments are aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the United Nations Guiding Principles on

ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Business and Human Rights, including the principles and rights set forth in the 8 “fundamental” conventions identified in the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work (covering subjects considered to be fundamental principles and rights at work, e.g., freedom of association and the right to collective bargaining, the elimination of all forms of forced or compulsory labour, the effective abolition of child labour, and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation) and the International Bill of Human Rights.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers adverse impacts of its investments on society and the environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusion of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 and 16 in portfolio management decisions exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator “investing in companies without carbon emission reduction initiatives” (i.e., PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the optional indicator “lack of anti-corruption and anti-bribery policies” (i.e. PAI 15) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund uses a combination of financial and non-financial indicators to identify securities. The sustainability criteria are designed to identify companies with strong environmental and social thematic exposures. The Sub-Fund follows a multi-thematic sustainable approach. The portfolio will be composed of issuers exposed to three long term mega trends, namely better resource efficiency, improved health as well as greater safety and resilience. The external investment manager ultimately seeks to invest in the economy of the future and has identified 21 sustainable themes that contribute in different ways to a cleaner, healthier and safer planet and which are connected to the three broader mega trends.

| | | |
|----------------------------|-----------------|-------------------------------|
| Better resource efficiency | Improved health | Greater safety and resilience |
|----------------------------|-----------------|-------------------------------|

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | | |
|--|--|--|
| <ul style="list-style-type: none"> • Improving the efficiency of energy use • Improving the management of water • Increasing electricity generation from renewable sources • Improving the resource efficiency of industrial and agricultural processes • Delivering a circular materials economy • Making transportation more efficient | <ul style="list-style-type: none"> • Providing affordable healthcare • Connecting people • Delivering healthier foods • Building better cities • Providing education • Enabling innovation in healthcare • Enabling healthier lifestyles • Encouraging sustainable leisure | <ul style="list-style-type: none"> • Increasing financial resilience • Saving for the future • Ensuring a sustainable economy • Leading ESG management • Improving transport safety • Enhancing digital security • Better monitoring of supply chains and quality control |
|--|--|--|

While a company must derive more than 25% of the value of its business directly from a theme, the external investment manager assesses how sustainable the rest of its activities are. For each business, the external investment manager determines the key ESG factors that are important indicators of future success and assess how well these are managed via the external investment manager proprietary tool named the Sustainability Matrix. Every company held in the portfolio is given a Matrix rating, which analyses the following two dimensional aspects:

- **Product sustainability (rated from A to E):** Assesses the extent to which a company's core business helps or harms society and/or the environment. An A rating indicates a company whose products or services contribute to sustainable development (via our investment themes); an E rating indicates a company whose core business is in a conflict with sustainable development (such as tobacco or very polluting activities such as coal fired electricity generation).
- **Management quality (rated from 1 to 5):** Assesses whether a company has appropriate structures, policies and practices in place for managing its ESG risks and impacts. Management quality in relation to the risks and opportunities represented by potentially material ESG issues are graded from 1 (excellent) to 5 (very poor).

In order to be investable, the company score must attain a minimum C3 rating. Engagement is also a key pillar of the external investment manager's approach. The external manager identifies three types of engagement: reactive, proactive and collaborative. Reactive engagement is initiated at the request of the external investment manager as a result of questions or concerns arising from the initial analysis of ESG issues, ongoing monitoring of holdings, emerging issues or controversies. Engagement also occurs at the request of a company (e.g., by providing feedback or advice on ESG initiatives). For proactive engagement, the external investment manager sets targets each year.

ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies non-compliant with SFDR Sustainable Investments mandatory norms and conventions | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >5% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Exclusion of the companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. According to the proprietary sustainable matrix of the external investment manager, the sub-fund will not invest in companies with a proprietary Sustainability Matrix scoring below C3.
- Sustainable investment eligibility criteria (the below criteria may not be cumulative):
 - Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed

ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Science Based Target (SBT)», or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets.

- o Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
- o Having a net positive aggregated Overall SDG Score by reference to the Sustainable Development Goals. The criterion is sourced from the external data provider ISS. This criterion assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer's product portfolio on the achievement of sustainability objectives. For corporate issuers the SDG Solutions Score considers only the most distinct objectives scores, i.e., the highest positive and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solutions Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.
- o Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of these criteria or (ii) a differentiated view of the company's impact assessment leveraging the External Investment Manager's proprietary methodology.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its "Good Governance Policy", the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS "exclusion policy" are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|--|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | | | |
|-----------------------|--|------------------------------------|---|
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The external investment manager assessment of good governance is systematically included in the research for each company as part of the decision on whether the business meets the requirements to be eligible for the Sub-Fund through the Sustainability matrix.

The assessment of the quality of management by the external investment manager includes the evaluation of the following elements: inter alia board structure, independence of board, key committees and auditors, stakeholder relationships including staff, customers and suppliers, pay alignment of board and staff with good business results. The external investment manager acknowledges different geographical contexts and what is good governance practice in the relevant region.



What is the asset allocation and the minimum share of sustainable investments?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the sustainable investment process in place, hence in investments that are defined as sustainable (#1 Sustainable). The external investment manager’s proprietary sustainable analysis covers 100% of the “#1 Sustainable” investments.” #1 Sustainable” investments include a minimum of 25% assets with environmental objectives and 25% with social objectives. Investments with environmental objectives are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy.

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Not Sustainable). “#2 Not Sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging purpose as a technique of portfolio management efficiency. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

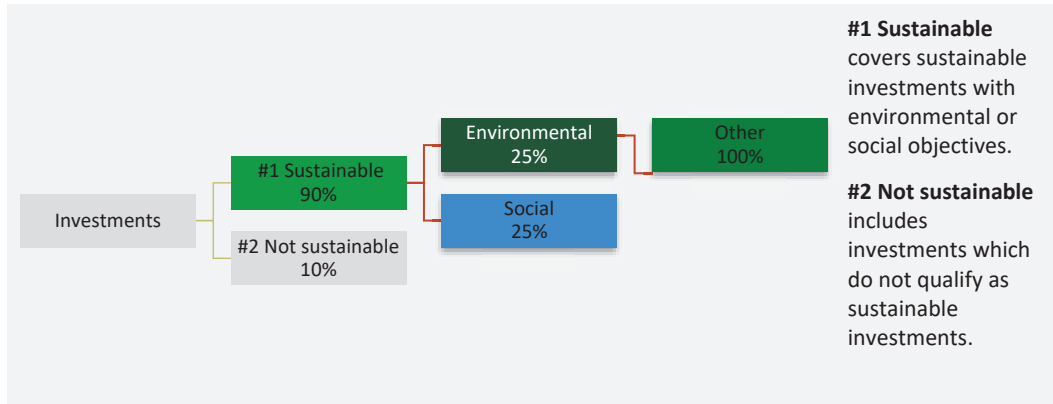
ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee



#1 Sustainable covers sustainable investments with environmental or social objectives.

#2 Not sustainable includes investments which do not qualify as sustainable investments.

● **How does the use of derivatives attain the sustainable investment objective?**

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund's sustainable investments with an environmental objective are not aligned with the EU taxonomy (i.e. 0%) as the investments with an environmental objective are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU taxonomy.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

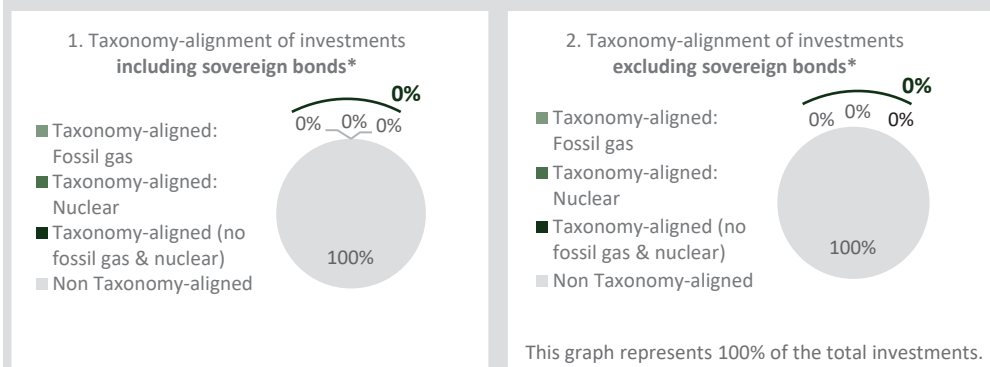
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy is 100%. The Sub-Fund commits to make a minimum of 25% sustainable investments with an environmental objective not aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund commits to make a 25% minimum share of sustainable investments with a social objective.



What investments are included under “#2 Not sustainable”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Not Sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging purpose as a technique of portfolio management efficiency. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.

ABN AMRO Funds Liontrust European Sustainable Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to meet the sustainable investment objective?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How does the reference benchmark take into account sustainability factors in a way that is continuously aligned with the sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Legal entity identifier:

549300LNEYGCDF2S5C79

Sustainable investment objective

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Yes | <input type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="checkbox"/> No |
|--|--|
| <p><input checked="" type="checkbox"/> It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: 35%</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy <input checked="" type="checkbox"/> in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy <p><input checked="" type="checkbox"/> It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: 35%</p> | <p><input type="checkbox"/> It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy <input type="checkbox"/> with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy <input type="checkbox"/> with a social objective <p><input type="checkbox"/> It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments</p> |



What is the sustainable investment objective of this financial product?

ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities (“the Sub-Fund) follows a multi-thematic sustainable investment strategy. The portfolio will be composed of issuers which are positively exposed to three long-term sustainable themes such as (i) better resource efficiency, (ii) improved health as well as (iii) greater safety and resilience.

The environmental sustainable investment objective of the Sub-Fund is to invest in businesses which support the goal of net zero greenhouse gas emissions by 2050, in line with the external investment manager’s Net-Zero Asset Managers Initiative (NZAM) commitment and the goals of the Paris Agreement. The practical working assumption is based on the Intergovernmental Panel on Climate Change (IPCC) analysis conclusion that to meet the Paris Agreement (to stay below 2 degrees centigrade ideally 1.5 degrees centigrade) of global warming we must reach net zero emissions by 2050. To achieve this

ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

the fund will reduce absolute emissions by 50% between 2020 and 2030, and a further 50% between 2030 and 2040 and a further 50% by 2050. This includes front-loaded absolute emission reduction targets (25% reduction by 2025 versus 2019 and 50% by 2030), as well as discouraging use of offsets in the investment manager's engagement with companies. This is measured through a number of different metrics to capture the multi-faceted aim of investing in companies consistent with climate change goals. This includes: exposure to companies reducing emissions (solution providers), the Sub-Fund's exposure to companies, carbon foot-printing that is consistent with the investment manager's NZAMI commitment. The approach is in line with the expectations of the Commission Delegated Regulation (EU) 2020/1818 relating to GHG scopes, calculation methodologies and exclusions. In addition, as part of its social sustainable investment objective, the Sub-Fund invests in companies contributing positively to social solutions.

To define the sustainable investment universe, a "pass-fail" approach is used using a set of criteria. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the sustainable objectives followed by the Sub-Fund.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The analysis of certain sustainability indicators is systematically integrated into the investment decision making process. The attainment of the sustainable investment objectives is assessed by investing in securities financing economic activities that substantially contribute to the environmental and/or social objectives mentioned above. To define the sustainable investment universe, a "pass-fail" approach using a set of criteria. No other criteria than the ones mentioned below are used to define the sustainable investment nature of an investment. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe.

To be eligible to the investment universe, the Management Company uses the below criteria:

- Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed Science Based Target (SBT)", or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets.
- Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
- Having a net positive aggregated overall SDG Score (by reference to the Sustainable Development Goals). This criterion, sourced from the external data provider ISS, assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer's product portfolio on the achievement of sustainability objectives. For corporate issuers the SDG Solutions Score considers only the most distinct objectives scores, i.e., the highest positive and/or the

Sustainability indicators measure how the sustainable objectives of this financial product are attained.

ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solutions Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.

- Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of these criteria or (ii) a differentiated view of the company's impact assessment leveraging the External Investment Manager's proprietary methodology.

How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?

The "Do No Significant Harm" (DNSH) principle is compiled by taking into account adverse impacts indicators listed in the Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022. The Sub-Fund takes into consideration (for some of them using proxies) all the mandatory adverse impact indicators listed in Table 1 of Annex 1 that are applicable to investee companies.

In addition, the Sub-Fund takes into consideration PAI No. 4 in Table 2 of Annex 2, applicable to investee companies, relating to investments in companies without carbon reduction initiatives. The Sub-Fund also takes into consideration PAI No. 15 of Table 3 of Annex 1, applicable to investee companies, relating to the lack of anti-corruption and anti-bribery policies.

How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

The Sub-Fund considers adverse impacts of its investments on society and the environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusions of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator "investing in companies without carbon emission reduction initiatives" (i.e., PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the indicator "lack of anti-corruption and anti-bribery policies" (i.e. PAI 15 in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.).

ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

The Sub-Fund's sustainable investments are aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights, including the principles and rights set forth in the 8 “fundamental” conventions identified in the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work (covering subjects considered to be fundamental principles and rights at work, e.g., freedom of association and the right to collective bargaining, the elimination of all forms of forced or compulsory labour, the effective abolition of child labour, and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation) and the International Bill of Human Rights.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers adverse impacts of its investments on society and the environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusions of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator “investing in companies without carbon emission reduction initiatives” (i.e., PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the indicator “lack of anti-corruption and anti-bribery policies” (i.e. PAI 15) using proxy indicators.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund uses a combination of financial and non-financial indicators to identify securities. The sustainability criteria are designed to identify companies with strong environmental and social thematic exposures. The Sub-Fund follows a multi-thematic sustainable approach. The portfolio will be composed of issuers exposed to three long term mega trends, namely better resource efficiency, improved health as well as greater safety and resilience. The external investment manager ultimately seeks to invest in the economy of the future and has identified 21 sustainable themes that contribute in different ways to a cleaner, healthier and safer planet and which are connected to the three broader mega trends.

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| Better resource efficiency | Improved health | Greater safety and resilience |
|--|--|--|
| <ul style="list-style-type: none"> • Improving the efficiency of energy use • Improving the management of water • Increasing electricity generation from renewable sources • Improving the resource efficiency of industrial and agricultural processes • Delivering a circular materials economy • Making transportation more efficient | <ul style="list-style-type: none"> • Providing affordable healthcare • Connecting people • Delivering healthier foods • Building better cities • Providing education • Enabling innovation in healthcare • Enabling healthier lifestyles • Encouraging sustainable leisure | <ul style="list-style-type: none"> • Increasing financial resilience • Saving for the future • Ensuring a sustainable economy • Leading ESG management • Improving transport safety • Enhancing digital security • Better monitoring of supply chains and quality control |

While a company must derive more than 50% of the value of its business directly from a theme, the external investment manager assesses how sustainable the rest of its activities are. For each business, the external investment manager determines the key ESG factors that are important indicators of future success and assess how well these are managed via the external investment manager proprietary tool named the Sustainability Matrix. Every company held in the portfolio is given a Matrix rating, which analyses the following two dimensional aspects:

- **Product sustainability (rated from A to E):** Assesses the extent to which a company's core business helps or harms society and/or the environment. An A rating indicates a company whose products or services contribute to sustainable development (via our investment themes); an E rating indicates a company whose core business is in a conflict with sustainable development (such as tobacco or very polluting activities such as coal fired electricity generation).
- **Management quality (rated from 1 to 5):** Assesses whether a company has appropriate structures, policies and practices in place for managing its ESG risks and impacts. Management quality in relation to the risks and opportunities represented by potentially material ESG issues are graded from 1 (excellent) to 5 (very poor).

Only companies which are rated A1-4, and B1-4 will be considered suitable for this Sub-Fund

Engagement is also a key pillar of the external investment manager's approach. The external manager identifies three types of engagement: reactive, proactive and collaborative. Reactive engagement is initiated at the request of the external investment manager as a result of questions or concerns arising from the initial analysis of ESG issues, ongoing monitoring of holdings, emerging issues or controversies. Engagement also occurs at the request of a company (e.g., by providing feedback or advice on ESG initiatives). For proactive engagement, the external investment manager sets targets each year.

ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies non-compliant with SFDR Sustainable Investments mandatory norms and conventions | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Exclusion of the companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. According to the proprietary sustainable matrix of the external investment manager, only companies which are rated A1-4, and B1-4 will be considered suitable for this Sub-Fund.
- Sustainable investment eligibility criteria (the below criteria may not be cumulative):
 - Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed

ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Science Based Target (SBT)», or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets.

- o Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
- o Having a net positive aggregated Overall SDG Score (by reference to the Sustainable Development Goals). The criterion is sourced from the external data provider ISS. This criterion assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer's product portfolio on the achievement of sustainability objectives. For corporate issuers the SDG Solutions Score considers only the most distinct objectives scores, i.e., the highest positive and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solutions Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.
- o Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of these criteria or (ii) a differentiated view of the company's impact assessment leveraging the External Investment Manager's proprietary methodology.

● **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its "Good Governance Policy", the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS "exclusion policy" are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|--|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | | | |
|-----------------------|--|------------------------------------|---|
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The external investment manager assessment of good governance is systematically included in the research for each company as part of the decision on whether the business meets the requirements to be eligible for the Sub-Fund through the Sustainability matrix. The assessment of the quality of management by the external investment manager includes the evaluation of the following elements: inter alia board structure, independence of board, key committees and auditors, stakeholder relationships including staff, customers and suppliers, pay alignment of board and staff with good business results. The external investment manager acknowledges different geographical contexts and what is good governance practice in the relevant region.



What is the asset allocation and the minimum share of sustainable investments?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the sustainable investment process in place, hence in investments that are defined as sustainable (#1 Sustainable). The external investment manager’s proprietary sustainable analysis covers 100% of the “#1 Sustainable” investments.” #1 Sustainable” investments include a minimum of 35% assets with environmental objectives and 35% with social objectives. Investments with environmental objectives are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy.

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Not Sustainable). “#2 Not Sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging purpose as a technique of portfolio management efficiency. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

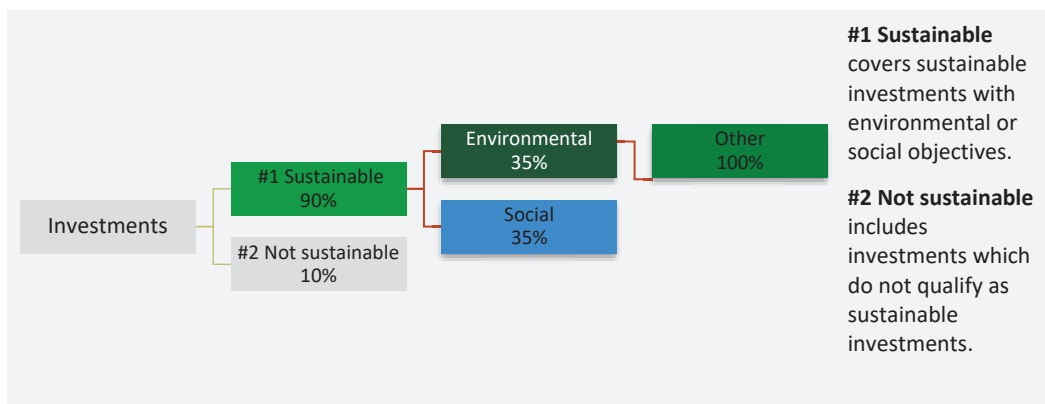
ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee



#1 Sustainable covers sustainable investments with environmental or social objectives.

#2 Not sustainable includes investments which do not qualify as sustainable investments.

● **How does the use of derivatives attain the sustainable investment objective?**

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund's sustainable investments with an environmental objective are not aligned with the EU taxonomy (i.e. 0%) as the investments with an environmental objective are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU taxonomy.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules.

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

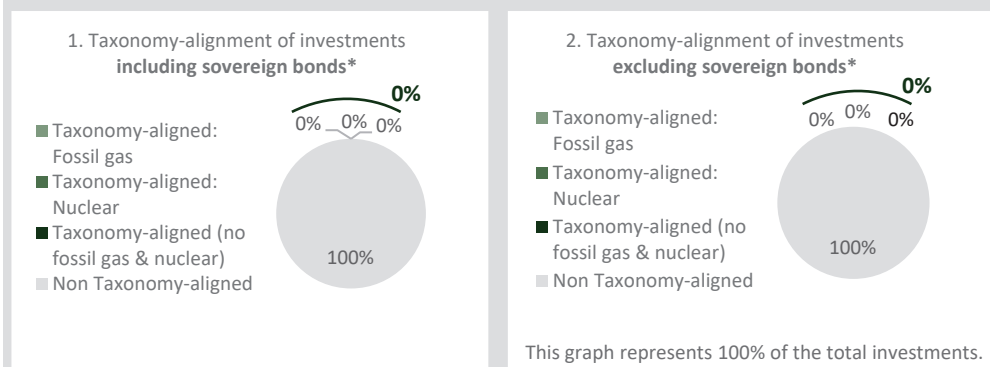
Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy is 100%. The Sub-Fund commits to make a minimum of 35% sustainable investments with an environmental objective not aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund commits to make a 35% minimum share of sustainable investments with a social objective.



What investments are included under “#2 Not sustainable”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Not Sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging purpose as a technique of portfolio management efficiency. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.

ABN AMRO Funds Liontrust Global Impact Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to meet the sustainable investment objective?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How does the reference benchmark take into account sustainability factors in a way that is continuously aligned with the sustainable investment objective?***
Not Applicable
- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***
Not Applicable
- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***
Not Applicable
- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***
Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities

Legal entity identifier:

5493003UERS4D705CR90

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading or improving on ESG practices.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund aims to invest in emerging market equities. Consideration of ESG Factors is fully integrated into fundamental analysis and investment decisions. The external investment manager's fundamental analysis includes an assessment of ESG Factors, alongside other financial and operational characteristics. Following the ESG-related quality assessment, the external investment manager quantifies ESG risks for these companies, to determine whether these have been accounted for, in company's valuation. The external investment manager favors issuers with better ESG characteristics where this is not detrimental to the pursuit of the investment objective.

Consideration of ESG Factors is fully integrated into analysis and investment decisions. In order to identify securities for purchase, the External Investment Manager reduces the potential investment universe (i) by screening out the exclusions (ii) by further analysing ESG factors to identify and take advantage of investment opportunities. This process results in a portfolio with better ESG characteristics. In constructing a portfolio positively tilted towards investments with better ESG characteristics, the External Investment Manager may nonetheless invest in investments across the full spectrum of ESG ratings.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- **What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|--|--------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >35% |
| Thermal Coal Extraction | >10% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis.

ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy

- **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

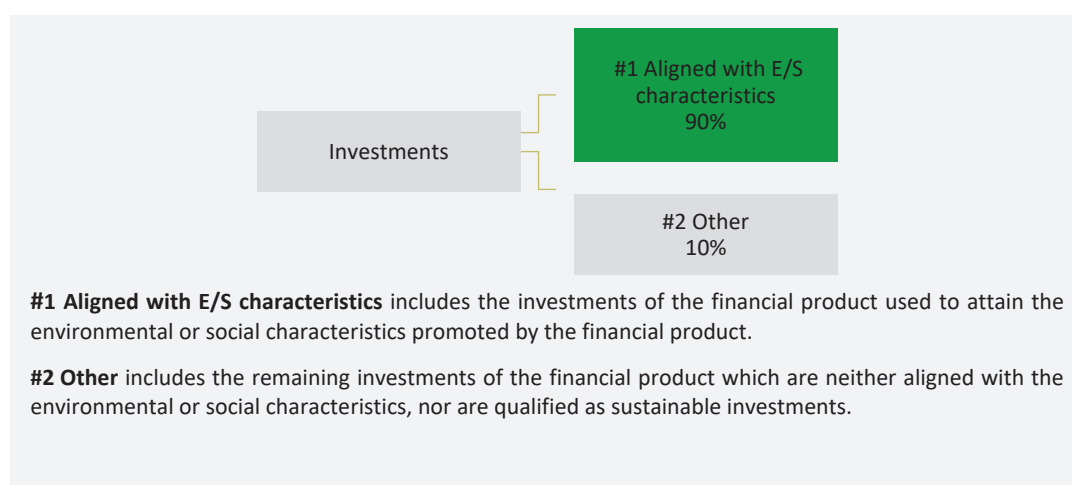
What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● *How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?*

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities

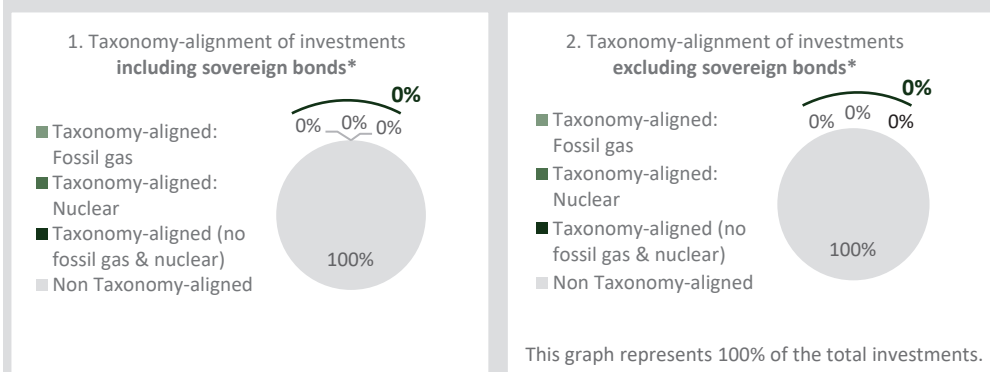
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds M&G Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Legal entity identifier:

549300DWB404Y7TZVH53

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of 30% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities (the "Sub-Fund"). The External Investment Manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the "Management Company") ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall sustainability strengths going from the

ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

The portfolio will be partially composed of companies exposed to the UN Sustainable Development Goals (SDGs). The Sub-Fund invests in companies contributing positively to environmental and social solutions. The Sub-Fund seeks to achieve positive environmental impact by investing primarily in companies that are leading the way to a zero-carbon economy and have approved Science-Based Targets. To define the sustainable investment universe, a “pass-fail” approach is used using a set of criteria. The DNSH principle is applied on all Sustainable Investments.

The analysis of certain sustainability indicators is systematically integrated into the investment decision making process of sustainable investments defined as securities financing economic activities that contribute to the environmental and/or social objectives mentioned above. To be eligible to the sustainable investment universe, the Management Company uses the below criteria:

- Having a net positive aggregated overall SDG score. This criterion, sourced from external data provider ISS, assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer’s product portfolio on the achievement of sustainability objectives. For corporate issuers, the SDG Solutions Score considers only the most distinct objective scores, i.e., the highest positive and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solution Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.
- Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed Science Based Target (SBT)", or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets.
- Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
- Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of these criteria or (ii) a differentiated view of the company's impact assessment leveraging the External Investment Manager's proprietary methodology.

ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?

The "Do No Significant Harm" (DNSH) principle is complied by taking into account adverse impacts indicators listed in the Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022. The Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make take into consideration (for some of them using proxies) all the mandatory adverse impact indicators listed in Table 1 of Annex 1 that are applicable to investee companies.

In addition, the Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make take into consideration PAI No. 4 in Table 2 of Annex 2, applicable to investee companies, relating to investments in companies without carbon reduction initiatives. The Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make also take into consideration PAI No. 15 of Table 3 of Annex 1, applicable to investee companies, relating to the lack of anti-corruption and anti-bribery policies.

How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

The Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make consider adverse impacts of its investments on society and the environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusions of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make take into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make consider the optional indicator "investing in companies without carbon emission reduction initiatives" (i.e., PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators. With respect to Table 3, the Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make consider the optional indicator "lack of anti-corruption and anti-bribery policies" (i.e. PAI 15) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

The Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make are aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights, including the principles and rights set forth in the 8 "fundamental" conventions identified in the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles

ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

and Rights at Work (covering subjects considered to be fundamental principles and rights at work, e.g., freedom of association and the right to collective bargaining, the elimination of all forms of forced or compulsory labour, the effective abolition of child labour, and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation) and the International Bill of Human Rights.

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

Any other sustainable investments must also not significantly harm any environmental or social objectives.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Moreover, the Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make consider adverse impacts of its investments on society and the environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusions of issuers associated with controversial conduct or activities.

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make take into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make consider the optional indicator “investing in companies without carbon emission reduction initiatives” (i.e., PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators. With respect to Table 3, the Sustainable Investments that the Sub-Fund intends to make consider the optional indicator “lack of anti-corruption and anti-bribery policies” (i.e. PAI 15) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

■ No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

The External Investment Manager has set up a process that integrates fundamental and ESG (Environment, Social and Governance) research to assess the business quality and valuation of potential companies. The ESG assessments include both exclusionary screens and a bottom up ESG evaluation. The investment strategy relies on a three-step process:

- In order to determine ESG performance, the External Investment Manager reviews first scoring from third-party ESG ratings providers (MSCI, ISS and Sustainalytics), evaluates how business controversies may materially impact companies, eliminates companies with exposure to controversial business lines, and performs a qualitative assessment on a broad range of ESG factors. The first task of the External Investment Manager is then to evaluate potential investments to ensure that they are compliant with the firm's exclusionary screens (Gambling, Alcohol, Tobacco, Weapons, Fossil Fuels).
- In a second step, the External Investment Manager performs an extensive analysis of retained companies in order to evaluate their ESG profile including ESG relevant issues (material risks and opportunities) within the context of the underlying sector and industry. The External Investment Manager analyses each investment candidate's environmental, social and governance record, including their environmental impact; how they treat their employees; the quality of their relationships with local communities, customers and the supply chain; and their corporate governance policies and practices. This analysis emphasizes those issues that are most relevant and risks that are most material to the company and compares the company under review with their peers. The External Investment Manager assign a proprietary rating to each company depending on their assessment of how well the company is managing material and reputational risks. These scores help determine whether the company meets the ESG threshold to be considered for investment.
- A one-page ESG risk report is compiled for each potential holding. The report distills available ESG information, summarizes key positives and risks, documents the numeric reputational and material risk scores described above, and identifies opportunities for engagement.
 - o Each security is issued a materiality risk and reputational risk rating. Materiality risk refers to the likelihood of a company being financially impacted by its management of ESG topics. Reputational risk refers to the likelihood of a company's reputation being impacted by its management of ESG topics. The ratings use a 1 – 4 scale with 1 being a low-risk and 4 being a severe risk. Positive (+) and negative (-) modifiers are used to determine trajectory of the ratings. Securities that are scored a 4 in either their Materiality or Reputational risk rating indicates a "Fail Recommendation".
 - o Companies rated in the bottom quartile of the investment universe, as assessed by the ESG process, will not be considered for investment.

This report is a tool for the Chief Investment Officer of the External Investment Manager to use in making a final decision about whether the company is eligible for inclusion in the portfolio.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the External Investment Manager ESG suitability analysis in terms of Exclusion and ESG inclusion. As part of the ESG inclusion selection process of the External investment Manager, are eligible for investment companies that score within the three first quartiles of the universe as defined by the External investment Manager ESG scoring methodology.
- A part of the exclusion policy of the External Investment Manager, are excluded from investment:
 - o companies that generate more than 10% of revenues from (or are the market leaders in) (i) Manufacture of Alcohol (ii) Fossil Fuels (iii) Extraction, exploration, production and/or refining of fossil fuels

ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- o companies operating in some controversial business activities such as deforestation, for-profit education or private prisons
- The Sub-Fund commits to return a lower Carbon emission exposure (scope 1 and 2) aggregated score than the benchmark.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below.

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |

ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | | | |
|-----------------------|-----------------------------------|----------------------|--|
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The External Investment Manager will evaluate the governance structure of any company under consideration for investment. As part of that process, the External Investment Manager considers shareholder-friendly policies and transparent reporting, leadership’s attention to ESG initiatives, management turnover, board accountability and expertise, executive compensation policies, women on board, as well as ownership and governance structures.



What is the asset allocation planned for this financial product?

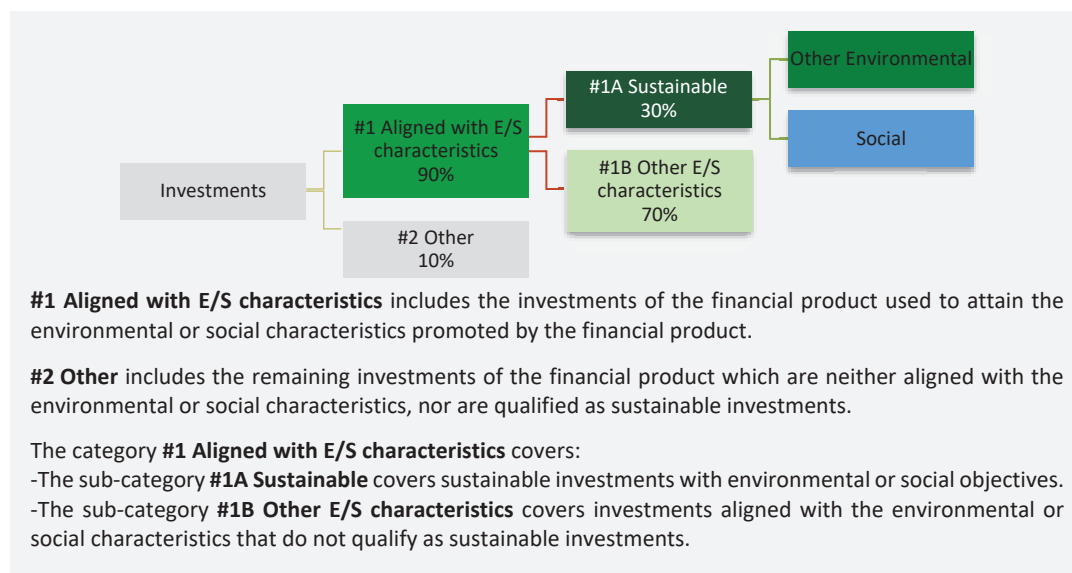
The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds), bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable

ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



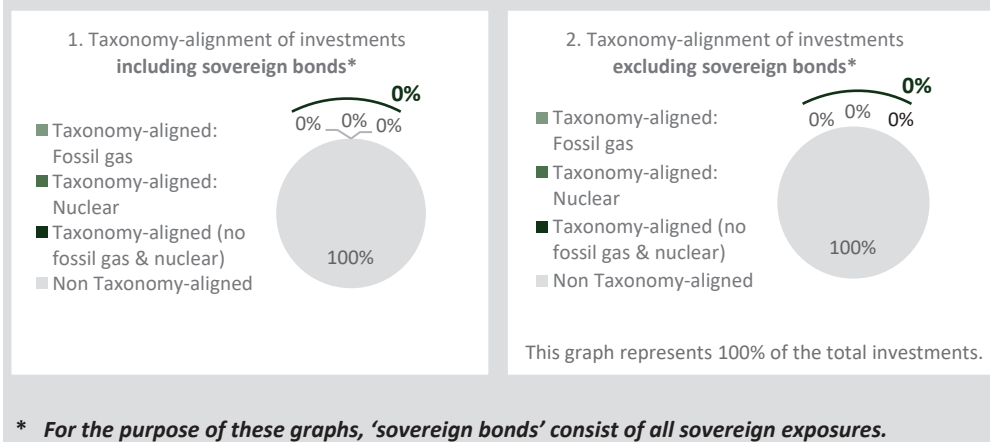
To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund's sustainable investments with an environmental objective are not aligned with the EU taxonomy (i.e. 0%) as the investments with an environmental objective are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU taxonomy.

● Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



● What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund invests at least 30% of assets in Sustainable Investments. Out of the aforementioned 30%, the Sub-Fund commits to invest a minimum of 5% into sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund invests at least 30% of assets in Sustainable Investments. Out of the aforementioned 30%, the Sub-Fund commits to invest a minimum of 5% into socially sustainable investments.



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- **How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable

- **How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?**

Not Applicable

- **How does the designated index differ from a relevant broad market index?**

Not Applicable

- **Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?**

Not Applicable

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Parnassus US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Legal entity identifier:

549300GBNQDBDYPB9S98

Sustainable investment objective

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Yes | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="checkbox"/> No |
|--|--|
| <p><input checked="" type="checkbox"/> It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: 40%</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy <input checked="" type="checkbox"/> in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy <p><input checked="" type="checkbox"/> It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: 10%</p> | <p><input type="checkbox"/> It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy <input type="checkbox"/> with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy <input type="checkbox"/> with a social objective <p><input type="checkbox"/> It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments</p> |



What is the sustainable investment objective of this financial product?

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds (“the Sub-Fund”) follows a multi-thematic sustainable investment strategy. The portfolio will be composed of entities exposed to the UN Sustainable Developments Goals (SDGs) and either considering the SDG Solutions Assessment (SDGA) methodology of the external data provider ISS (at entity level), or using an internal methodology to analyse the use of proceeds of the debt instrument (when considering green or social bonds). As part of its sustainable investment objective, the Sub-Fund invests in entities contributing positively to environmental and social solutions. To define the sustainable investment universe, a “pass-fail” approach is used using a set of criteria. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the sustainable objectives followed by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the sustainable objectives of this financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The analysis of certain sustainability indicators is systematically integrated into the investment decision making process. The attainment of the sustainable investment objectives is assessed by investing in securities financing economic activities that substantially contribute to the environmental and/or social objectives mentioned above. To define the sustainable investment universe, a “pass-fail” approach is used using a set of criteria. No other criteria than the one mentioned below are used to define the sustainable investment nature of an investment. The DNSH principle is always applied on the entire investment universe.

To be eligible to the investment universe, the Management Company uses the below criteria:

- Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed Science Based Target (SBT)", or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets
- Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS
- Having a net positive aggregated overall SDG score (by reference to the Sustainable Development Goals). This criterion, sourced from the external data provider ISS, assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer's product portfolio on the achievement of sustainability objectives. For corporate issuers the SDG Solutions Score considers only the most distinct objective scores, i.e., the highest positive and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solution Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.
- Exposure to Green, Social, Sustainability or SDG bonds and related debts instruments. The Management Company will assess the use of proceeds eligibility.
- Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of these criteria or (ii) a differentiated view of the company's impact assessment made by the investment manager and based on other sources.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?

The "Do No Significant Harm" (DNSH) principle is complied by taking into account adverse impacts indicators listed in the Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022. The Sub-Fund takes into consideration (for some of them using proxies) all the mandatory adverse impact indicators listed in Table 1 of Annex 1 that are applicable to investee companies, sovereigns and supranationals.

In addition, the Sub-Fund takes into consideration PAI No. 4 in Table 2 of Annex 2, applicable to investee companies, relating to investments in companies without carbon reduction initiatives. The Sub-Fund also takes into consideration PAI No. 15 of Table 3 of Annex 1, applicable to investee companies, relating to the lack of anti-corruption and anti-bribery policies. The Sub-Fund takes into account PAI No.17 in Table 2, applicable to sovereigns and supranationals, relating to "Share of bonds not issued under Union legislation on environmentally sustainable bonds". The Sub-Fund also takes into consideration PAI No. 20 of Table 3, applicable to sovereigns and supranationals, relating to investments "Average human rights performance".

How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

The Sub-Fund considers and mitigates adverse impacts of its investments on society and environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusions of issuers associated with controversial conduct or activities.

On the corporate side:

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) 1 to 14 in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator "investing in companies without carbon emission reduction initiatives" (i.e. PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the optional indicator "lack of anti-corruption and anti-bribery policies" (i.e. PAI 15) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

On the sovereign and supranational side:

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into consideration mandatory principal adverse impacts in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator "Share of bonds not issued under Union legislation on environmentally sustainable bonds" (i.e. PAI 17) in portfolio management decisions.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the optional indicator “Average human rights performance” (i.e. PAI 20) in portfolio management decisions using proxy indicators.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

— — — **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

The Sub-Fund's sustainable investments are aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights, including the principles and rights set forth in the 8 “fundamental” conventions identified in the International Labor Organization's Declaration on Fundamental Principles (covering subjects that were considered to be fundamental principles and rights at work, e.g. freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining, the elimination of all forms of forced or compulsory labour, the effective abolition of child labour, and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation) and Rights at Work and the International Bill of Human Rights. Alignment is ensured through exclusions.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers and mitigates adverse impacts of its investments on society and environment through a combination of portfolio management decisions, engagement, and exclusion of issuers associated with controversial conduct or activities.

On the corporate side:

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund takes into account mandatory principal adverse impacts (PAI) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator “investing in companies without carbon emission reduction initiatives” (i.e. PAI 4) in portfolio management decisions and engagement activities using proxy indicators.

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the optional indicator “lack of anti-corruption and anti-bribery policies” (i.e. PAI 15) in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

On the sovereign and supranational side:

With respect to Table 1 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1288 of 6 April 2022, the Sub-Fund considers the mandatory principal adverse impacts in portfolio management decisions and exclusions using proxy indicators.

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

With respect to Table 2, the Sub-Fund considers the optional indicator “Share of bonds not issued under Union legislation on environmentally sustainable bonds” (i.e. PAI 17) in portfolio management decisions..

With respect to Table 3, the Sub-Fund considers the optional indicator “Average human rights performance” (i.e PAI 20) in portfolio management decisions using proxy indicators.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

No



What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund will invest in Euro Investment Grade denominated (Sub)Sovereign, and Supranationals bonds incorporating as well, corporate bonds to the portfolio. The selection process targeting impact solutions would give the preference to green/ social/ sustainability/SDG bonds. Nonetheless, the Sub-Fund aims to invest at least 50% of its securities in Green, social, sustainability or SDG Bonds that have been qualified as such by an external party. The 50% target is subject to the flow of upcoming emissions which pass the sustainability filters.

The Sub-Fund uses a combination of financial and non-financial indicators to identify securities. It aims to foster the growth of a sustainable global economy without compromising returns. The sustainability criteria are designed to identify companies with strong environmental and social thematic exposures and more globally, debts instruments financing projects that are in line with the sustainability indicators. The Sub-Fund is actively managed combining both quantitative and qualitative financial modelling and impact research. Investments will be made into companies and/or projects with growth driven by long term sustainable impact themes and with the intent to contribute to measurable positive social, economic and environmental impact alongside financial returns. The Sub-Fund can invest in Companies, in Sovereign and in Supranational bonds.

Regarding corporate Investment: those are only aimed at companies that generate a net positive impact. These are companies with products or services that bring positive impact to the environment, climate and society. The process of selecting companies starts with applying quantitative screens on the global universe by using external ESG data providers. These screens consist of activity-based and norm-based exclusions, best-in-class ESG score (companies that are not scoring within the 50th percentile of each sector are not suitable for investing) and SDG’ solutions impact score.

Regarding countries and public organisations investments: The analysis is carried out at the country level. The process of selecting countries starts with applying quantitative screens on the global universe of countries by using external ESG data providers. These screens consist of activity-based and norm-based exclusions, and ESG risk score threshold (High and severe ESG risk scores are not eligible).

Regarding Supranational investments: the Sub-Fund does not follow a best-in-class approach for Supranational entities as their existence is tied almost directly to impact objective of adding to the United Nations Sustainable Development goals. Nonetheless the Sub-Fund will verify that the entity objectives are in line with its sustainable objectives.

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

When investing in green, social, sustainability or SDG bonds, the Sub-Fund may not apply the above screening; Nonetheless, the Sub-Fund will make sure that the bond's use of proceeds is verified by a third-party and that the objective of the bond is in line with the objectives of the Sub-Fund.

After this initial quantitative screening, the last step consists of the qualitative assessment performed by the investment manager of the Sub-Fund. The portfolio manager will ascertain the positive impact the selected investment bring.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies non-compliant with SFDR Sustainable Investments mandatory norms and conventions | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |
| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | |
|---|-----|
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Sustainable investment eligibility criteria as below:
 - o Having a greenhouse gas emission reduction target. The criterion is sourced from the external data provider ISS and differentiates an issuer's targets as "No Target", "Non-Ambitious Target", "Ambitious Target", "Committed Science Based Target (SBT)", or "Approved Science Based target (SBT)" based on the existence and quality of greenhouse gas emissions reduction targets
 - o Being aligned with the International Energy Agency (IEA) Sustainable Development Scenario (SDS) for the full analysed period (until 2050). The criterion is sourced from the external data provider ISS and identifies the year in which the company estimated future carbon emissions are non-longer aligned with the issuer's estimated carbon emissions budget required to be aligned with the IEA SDS.
 - o Having a net positive aggregated overall SDG score (by reference to the Sustainable Development Goals). This criterion assesses the overall, aggregated impact (positive and negative netting) of an issuer's product portfolio on the achievement of sustainability objectives. For corporate issuers the SDG Solutions Score considers only the most distinct objective scores, i.e., the highest positive and/or the lowest negative score, based on contributing and obstructing impacts on sustainability objectives. The SDG Solutions Score is calculated as the sum of the highest positive and the lowest negative objective score and ranges on a scale from -10.0 to 10.0.
 - o Exposure to Green, Social, Sustainability or SDG bonds and related debts instruments; The above criteria may not apply to the issuer of the debt instrument as the Sub-Fund will assess the use of proceed eligibility
 - o Exposure to companies that do not meet the above criteria, but for which there is (i) a path of engagement with the company that could lead to meeting one or more of these criteria or (ii) a differentiated view of the company's impact assessment leveraging the External Investment Manager's proprietary impact methodology..

- ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its "Good Governance Policy", the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS "exclusion policy" are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

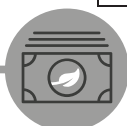
ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Note that the good governance requirements outlined in the SFDR regulation are only applicable to investments in corporates.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |



What is the asset allocation and the minimum share of sustainable investments?

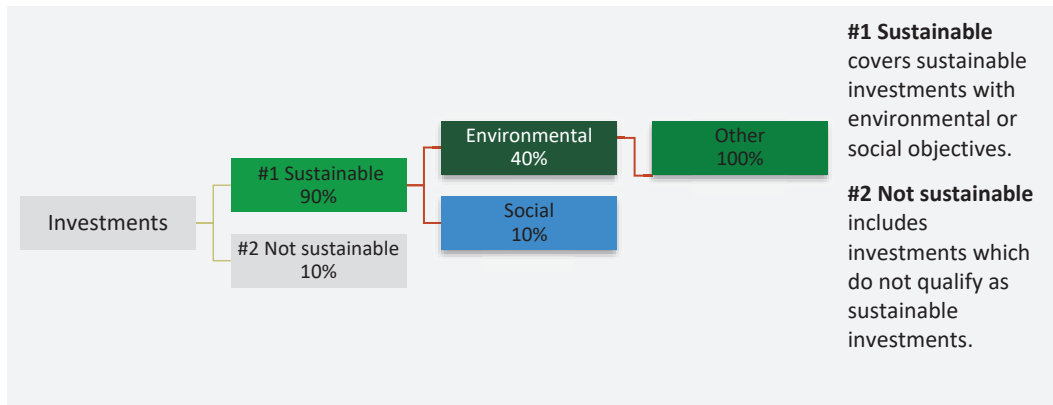
The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the sustainable investment process in place, hence in investments that are defined as sustainable (#1 Sustainable). The proprietary sustainable analysis covers 100% of the “#1 Sustainable” investments.” #1 Sustainable” investments include a minimum of 40% assets with environmental objectives and 10% with social objectives. Investments with environmental objectives are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy.

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Not Sustainable). “#2 Not Sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for hedging purposes. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.



#1 Sustainable covers sustainable investments with environmental or social objectives.

#2 Not sustainable includes investments which do not qualify as sustainable investments.

- **How does the use of derivatives attain the sustainable investment objective?**
Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund's sustainable investments with an environmental objective are not aligned with the EU taxonomy (i.e. 0%) as the investments with an environmental objective are made in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU taxonomy.

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

Yes:

In fossil gas In nuclear energy

No

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules.

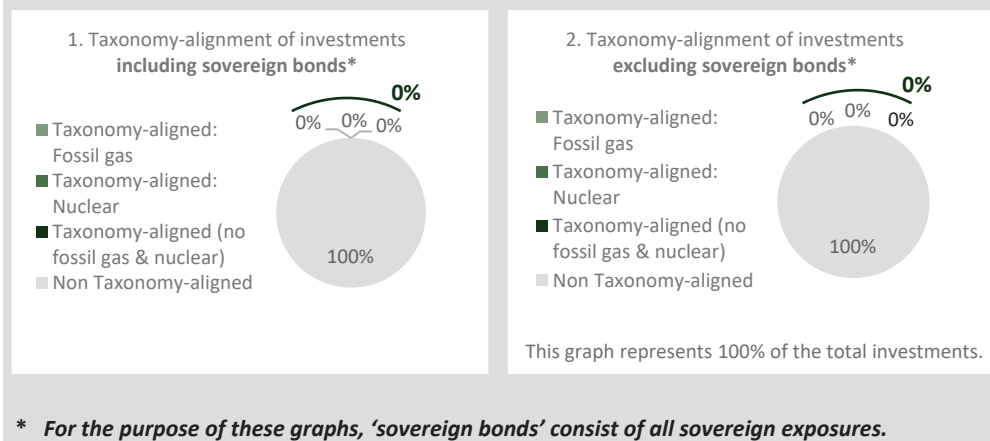
Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy is 100%. The Sub-Fund commits to make a minimum of 40% sustainable investments with an environmental objective not aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund commits to make a 10% minimum share of sustainable investments with a social objective.



What investments are included under “#2 Not sustainable”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Not sustainable” includes derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for hedging and efficient management portfolio purposes. The proportion and use of investments that are considered as not sustainable does not affect the delivery of the sustainable investment objective, as these investments are neutral to such objective. Besides, minimum environmental or social safeguards are only applied to the underlying investments when relevant. The nature of these assets does not undermine the sustainable objectives pursued by the Sub-Fund. A more detailed description of the



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Impact Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1, to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.



Is a specific index designated as a reference benchmark to meet the sustainable investment objective?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How does the reference benchmark take into account sustainability factors in a way that is continuously aligned with the sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html)
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- [Documents of the Sub-Fund:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html)
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

Legal entity identifier:

549300WAD3VMVWTT3Z05

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds (the “Sub-Fund”). ESG integration is defined as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria.

ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the financial product.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The analysis of ESG factors is integrated into the investment decision making process. The attainment of the promoted environmental and social characteristics is assessed via the application of a proprietary ESG assessment methodology.

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions - Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour).
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.

ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Government emissions.

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

Not Applicable

How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement. On the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

No



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

To select eligible securities, the Management Company performs both a financial and non-financial analysis, using ESG criteria in combination with exclusions filters. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics. The Sub-Fund invest mainly in companies and in Sovereigns via debts instruments ("the securities") and may also invest in units or share of of undertakings for collective investments including exchange traded funds - ETF ("the investment funds").

The process of selecting the eligible securities starts with applying quantitative screens on a global universe by using the external ESG data provider Sustainalytics. These screens consist of activity-based and norm-based exclusions (negative filters) and ESG risk scores classification (positive filters). The purpose of the negative filters is to eliminate from investment, companies that violate international standards, activities that might have a negative effect on society and on environment (as tobacco and thermal coal). The Management Company will then rank the securities according to their ESG risk score as evaluated by Sustainalytics. The purpose of the ranking is to better allocate the ESG risk score in the portfolio. The Management company will only retain securities with an ESG risk score that is either negligible, low, medium or high. Investing in severe ESG risk score (>40) is not allowed. Moreover, as part of the controversy assessment and using Sustainalytics as the data source provider, the Management company will exclude companies with the highest controversy score (i.e level 5-severe out of 6 levels from 0 to 5).

The Management Company may invest in external or internal funds to expose the Sub-Fund on specific market (as emerging markets, for example). Those investment funds promote environmental and social characteristics and qualifies as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector ("SFDR Article 8") or contributes to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector ("SFDR art.9"). External investment funds are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes to the capabilities in place and the portfolio construction. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company (i.e., applicable only to direct investments).

The management team will select the securities within the eligible universe as filtered above and will construct the portfolio based on financial criteria (top-down and bottom up) to attain the financial objectives of the fund.

ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|--------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Thermal Coal Extraction | >10% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund ESG suitability criteria for investments as defined below:
 - o Direct investments: securities with an ESG risk score below 40 are eligible and a controversy level of 5 (or "severe") based on Sustainalytics data.
 - o Indirect investments: investment funds that promote environmental and social characteristics and qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or that contribute to environmental and social objectives and qualify as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services.
- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

● *What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?*

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The good governance requirements outlined in the SFDR regulation are only applicable to investments in companies. Nonetheless, the external investment manager has in place a good governance methodology when it comes to consider emerging markets state-owned companies, sovereign agencies and sovereigns.

ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

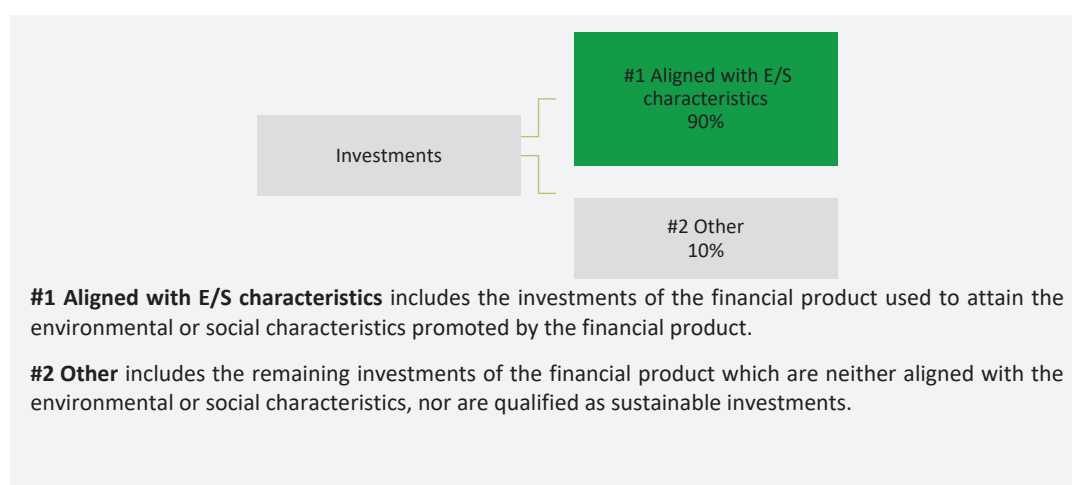


Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Consequently, up to 10% of the investments may not be aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes investment funds (inc. ETF) that are not classified as “SFDR article 8” or “SFDR article 9”, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.



Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

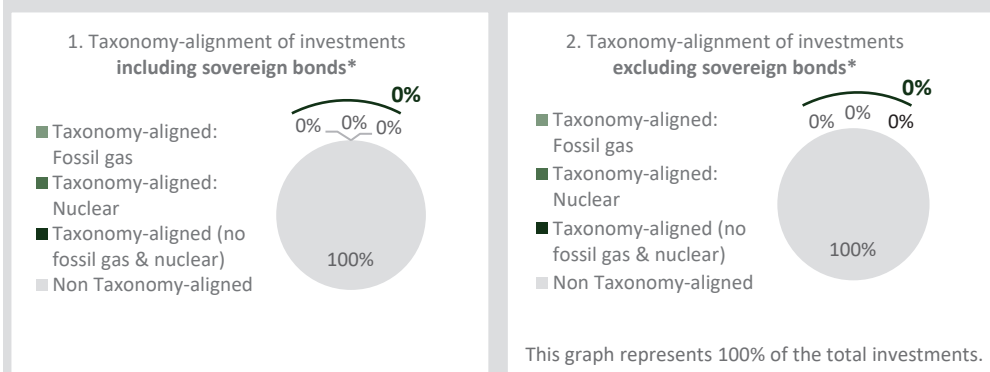
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Private Portfolio Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes investment funds (inc.ETF) that are not classified as “SDFR Article 8” or “SFDR article 9”, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html)
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>

- [Documents of the Sub-Fund:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html)
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

Legal entity identifier:

549300R2N855J64YLN17

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities (the “Sub-Fund”). ESG integration is defined as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria.

ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights and labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The analysis of ESG factors is integrated into the investment decision making process. The attainment of the promoted environmental and social characteristics is assessed via the application of a proprietary ESG assessment methodology.

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?

Not Applicable

How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

Not Applicable

How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, it strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

No

What investment strategy does this financial product follow?

To select eligible securities, the Management Company performs both a financial and non-financial analysis, using ESG criteria in combination with exclusions filters. The Sub-Fund’s assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics. The Sub-Fund will mainly invest in companies (equities) and may also invest in units or share of undertakings for collective investments (including exchange traded funds).

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The process of selecting companies starts with applying quantitative screens on a global universe by using the external ESG data provider Sustainalytics. These screens consist of activity-based and norm-based exclusions (negative filters) and ESG risk scores classification (positive filters). The purpose of the negative filters is to eliminate from investment, companies that violate international standards, activities that might have a negative effect on society and on environment (as tobacco and thermal coal). The Management Company will then rank the securities according to their ESG risk score as evaluated by Sustainalytics. The purpose of the ranking is to better allocate the ESG risk score in the portfolio. The Management company will only retain securities with an ESG risk score that is either negligible, low, medium or high. Investing in severe ESG risk score (>40) is not allowed. Moreover, as part of the controversy assessment and using Sustainalytics as the data source provider, the Management company will exclude companies with the highest controversy score (i.e level 5-severe out of 6 levels from 0 to 5).

The management team may invest in external or internal funds to expose the Sub-Fund on specific market (as emerging markets, for example). Those investment funds promote environmental and social characteristics and qualifies as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector (“SFDR Article 8”) or contributes to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector (“SFDR article 9). External investment funds are selected in accordance with the Management Company’s standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes to the capabilities in place and the portfolio construction. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the “Sustainability Investment Policy” of the Management Company (i.e., applicable only to direct investments).

The management team will select the securities within the eligible universe as filtered above and will construct the portfolio based on financial criteria (top-down and bottom up) to attain the financial objectives of the fund.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company’s exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|--|--------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact’s Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |

ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
|--|------|
| Thermal Coal Extraction | >10% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-fund ESG suitability analysis for investments as defined below:
 - o Direct investments: securities with an ESG risk score below 40 are eligible and a controversy level of 5 (or “severe”) based on Sustainalytics data.
 - o Indirect investments: investment funds that promote environmental and social characteristics and qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or that contribute to environmental and social objectives and qualify as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|--|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | | | |
|-----------------------|--|------------------------------------|---|
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund plans to invest at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics)).

Consequently, up to 10% of the investments may not be aligned with these characteristics (#2 Other). ““#2 Other” includes investment funds (and ETF) that are not classified as “SFDR Article 8” or “SFDR article 9”, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.

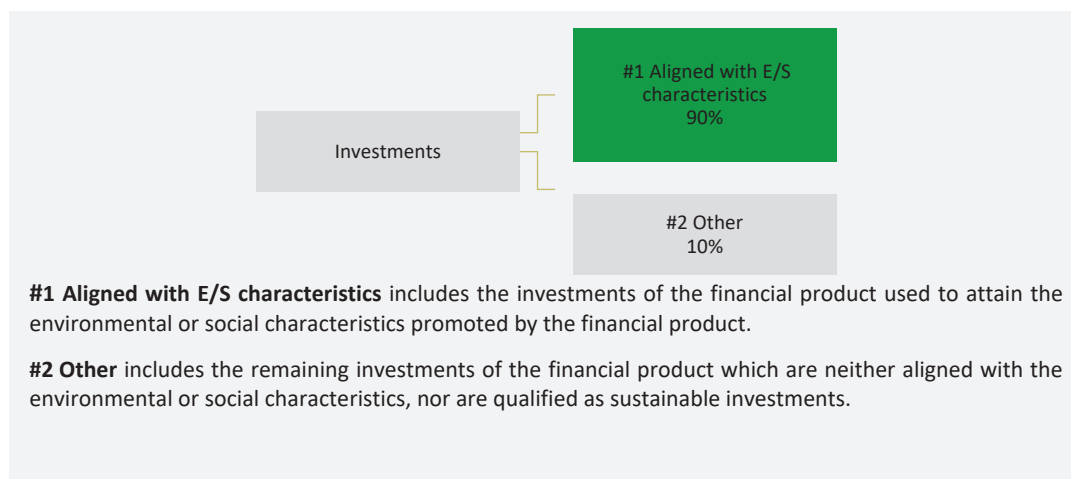
Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



#1 Aligned with E/S characteristics includes the investments of the financial product used to attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product.

#2 Other includes the remaining investments of the financial product which are neither aligned with the environmental or social characteristics, nor are qualified as sustainable investments.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

Yes:

In fossil gas

In nuclear energy

No

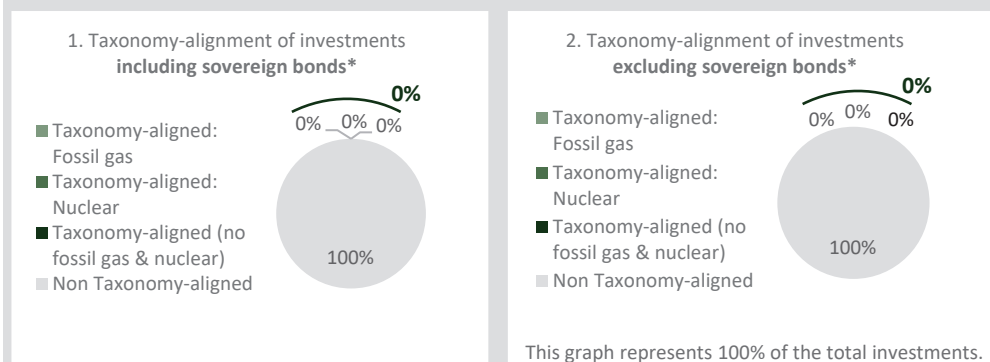
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes investment funds (and ETF) that are not classified as “SFDR Article 8” or “SFDR article 9”, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.

ABN AMRO Funds Private Portfolio Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

Legal entity identifier:

549300KADHEV1F9AHS35

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria.

The External Investment Manager must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate

ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

social responsibility policy as well as its overall sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights and labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, it strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

The strategy is actively managed through a proprietary ESG fundamental research driven approach and is complemented by an engagement approach. The ESG fundamental research driven approach is guided by the External Investment Manager 's internally developed materiality map and thematic maps inspired and guided by the Sustainability Accounting Standards Board (SASB), now part of the International Sustainability Standards Board (ISSB).

The materiality map helps to utilize context specific analysis for individual companies and identifies key criteria for each potential sustainability leadership within their industry. Markers of sustainability leadership include:

- Material: Are the areas of sustainability leadership relevant to long-term business success?
- Proactive: Does the activity go above and beyond compliance or sufficiency?
- Progressive: Is reporting transparent and analysable?
- Effective: Can we identify meaningful positive impact both for the company and beyond (customers, suppliers, and systems)?

As an illustration of the materiality map,

- Key criteria to measure sustainability leadership in Utilities with regards to:
 - Governance: board structure and composition, management incentives, ownership, systemic risk management and leadership and corporate purpose, culture and mission alignment
 - Social: diversity, equity and inclusion, employee well-being and development.
 - Environment: climate change risk, climate change mitigation and adaptation, GHG Emissions, energy intensity and renewable energy use, biodiversity and ecosystems impact
- Key criteria to measure sustainability leadership in healthcare with regards to:
 - Governance: board structure and composition, management incentives, ownership, systemic risk management and leadership and corporate purpose, culture and mission alignment
 - Social: diversity, equity and inclusion, employee well-being and development, supplier, distribution and marketing management, product impact and customer well-being, pricing philosophy and access and Privacy, data security and data use.

The thematic map complements the External investment Manager's materiality map by asking forward-looking questions (e.g., What is needed to improve the health of individuals, communities, and the planet? How can we invest in resilience and regeneration?). The sustainability research focuses on three overarching categories: thriving people, thriving planet, thriving public. The thematic map helps the External investment Manager to identify potential solutions to key sustainability challenges. Markers of companies leading the way and providing solutions include:

- Need: Is the solution meeting an identified need and contributing to a thriving world?
- Improvement: Does the solution offer meaningful benefits versus prior options?
- Advancing: Are the positive impacts increasing over time, through added scope, scale or performance?

ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Effective: Can we identify meaningful positive impact for the company and beyond (customers, suppliers, and systems)?

The investment process is inclusionary, focused on identifying companies where excellence in sustainability (i.e., materiality map) is adding to long-term fundamental business prospects (i.e., thematic map).

The integrated research aims to identify two types of companies: sustainable leaders and sustainable solutions:

- Sustainable leaders are companies that have demonstrated leadership in the sustainability issues that are financially material to their businesses. The investment thesis is that companies that exhibit this type of commitment also often demonstrate potential for strong long-term financial performance.
- Sustainable solutions providers are companies whose products and services provide solutions to essential sustainability challenges. The belief is that solutions-oriented companies with potential to create positive social and environmental impact also demonstrate potential for strong growth and long-term financial performance.

Methodological limitations can be assessed in terms of nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |

ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | |
|---|------|
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Exclusion of companies that do not pass the external investment manager's ESG suitability analysis. The External Investment Manager uses the data point from the external data provider Sustainalytics; the ESG Risk Rating. The rating is a single score, but it is composed of two main parts: "Exposure" measures a company's vulnerability or susceptibility to ESG risks. "Management" refers to actions taken by a company to manage a particular ESG issue. This can include a company's ESG issues and policies. Controversies can have a negative impact on a firm's management score because they often reveal that company initiatives were insufficient or ineffective. The ESG Risk Rating Assessment blends the exposure score and the management score together into a single score that tells how at risk a company's enterprise value is from ESG issues. The ratings sort companies into five risk categories: negligible, low, medium, high, severe. The External Investment Manager will not invest in companies rated as severe 10% of the global universe rated by Sustainalytics find themselves in the severe bucket. They are facing the highest level of material ESG risk.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its "Good Governance Policy", the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS "exclusion policy" are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

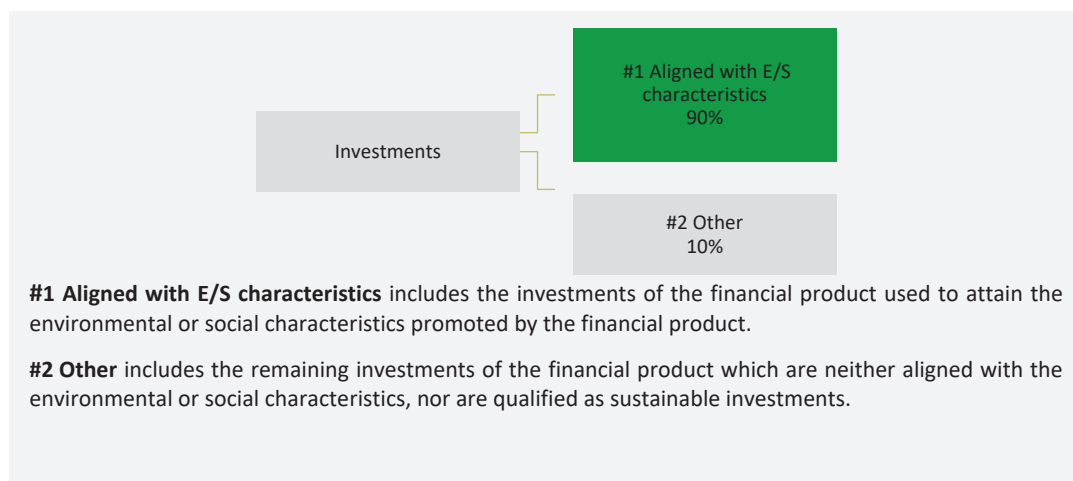
ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.



#1 Aligned with E/S characteristics includes the investments of the financial product used to attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product.

#2 Other includes the remaining investments of the financial product which are neither aligned with the environmental or social characteristics, nor are qualified as sustainable investments.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

Yes:

In fossil gas

In nuclear energy

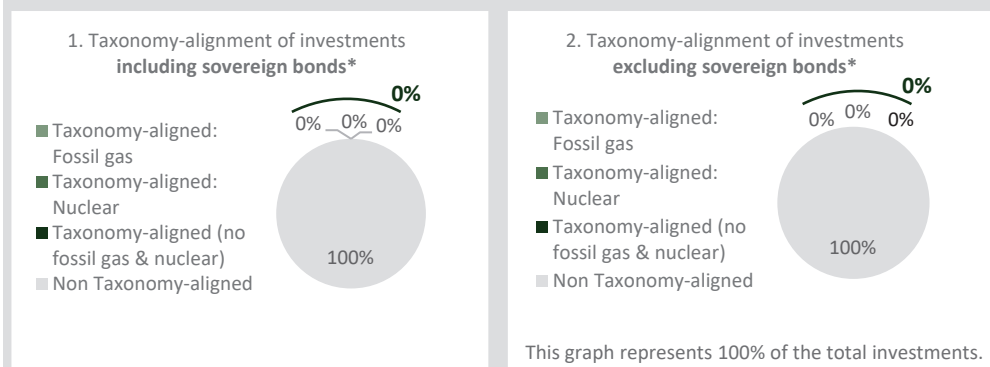
No

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

ABN AMRO Funds Putnam US ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***
Not Applicable
- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***
Not Applicable
- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***
Not Applicable
- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***
Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Legal entity identifier:

549300PX4Q6GP6GWDT19

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?



Yes



No



It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%



in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%



It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments



with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



with a social objective



It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-related Bonds (the “Sub-Fund”). The External Investment Manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Manager must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights and labour standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.

ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company .

On the Sovereign side:

- Absence of countries that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions
- Investments in companies, government-related, and sovereign bonds with a positive or neutral SDG score based on the internally developed SDG Framework.

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

— ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

— ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

No



What investment strategy does this financial product follow?

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

The Sub-Fund seeks to invest in investment grade euro denominated government-related bonds. ESG factors are incorporated in the decisions made in the investment process. The External Investment Manager uses three frameworks: the Fundamental Score framework, the SDG Framework and the Green Bonds Framework.

Sequencing starts with applying an SDG filter to the investment universe. Only the issuing entities (companies, government related entities, sovereigns) with a neutral or positive SDG score will be investable. The Country SDG Framework assesses (i) whether the policies of the country are advancing or detracting the UN SDGs, (ii) if a country lacks access to capital markets (iii) the controversies that the country might be involved in. On the corporate side, the Company SDG Framework is a 3-step analysis of a company’s contribution to the UN SDGs, which (i) assesses the impact of the company’s products on relevant SDGs, (ii) assesses the compatibility of the company’s operations with these SDGs, and (iii) monitors

ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

controversies continuously. Both countries and companies are assigned an SDG Score ranging from -3 to +3. For Green, Social and Sustainable bonds the sequencing starts with the five-step eligibility process. Only the bond that have a positive score on each of these five criteria will be eligible for investment in the Sub-Fund.

After these eligibility checks, the selection process of the individual securities will take place. ESG is fully integrated into the fundamental bottom-up credit analysis conducted by the External Investment Manager to identify investment opportunities. When it comes to sovereign credit analyses, the External Investment Manager assigns each country with a Fundamental Score (*F-Score*), ranging from -3 to +3, that provides a detailed overview of the current developments in the country. The Country F-Score is calculated based on the Financial Health, Macroeconomic Cycle, and ESG profile of the country. The country ESG profile is based on the External Investment Manager Country Sustainability Ranking assessing the position of a country relative to other countries on 15 ESG criteria. For corporates, the External Investment Manager evaluates the issuer's cash generating capacity, its ability to repay debt, and the quality of its cash flows. ESG Factors are part of the overall analysis. Similar to countries, this assessment allows the External Investment Manager to assign each issuer with a Company F-Score ranging from -3 to +3.

Taking into account the Country and Corporate Fundamental Scores, the External Investment Manager constructs the portfolio.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |

ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | |
|---|-----|
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >5% |
| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The list above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Exclusion of the companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. The External Investment Manager considers for inclusion in the portfolio issuing entities with a neutral or positive SDG score.

- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

- ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The good governance requirements outlined in the SFDR regulation are only applicable to investments in companies.



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

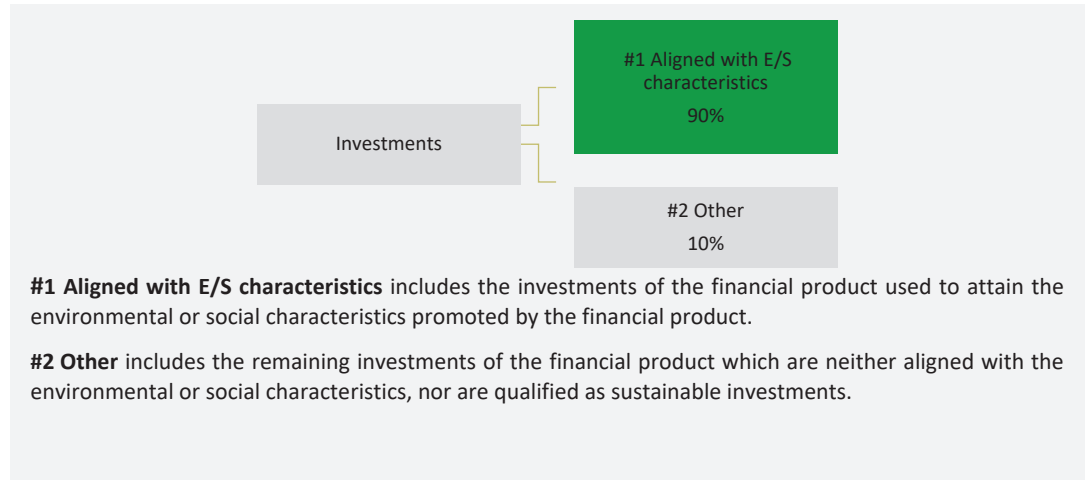
ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy²?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

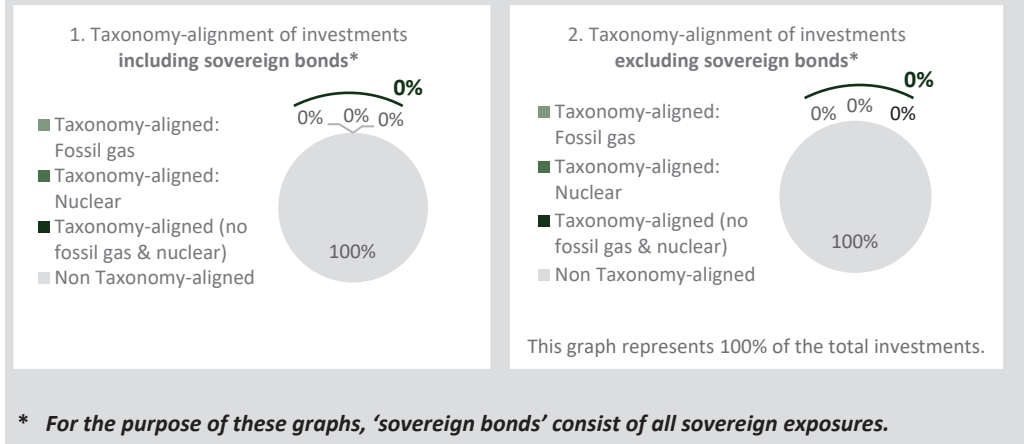
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

² Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

ABN AMRO Funds Robeco Euro ESG Government-Related Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- *ABN AMRO Investment Solutions's Sustainable Investment Policy:*
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abnamro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>

- *Documents of the Sub-Fund:*
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities

Legal entity identifier:

549300XU783WQKIKOT55

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are leading or improving in ESG practices.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

Not Applicable

How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund aims to invest in emerging market equities. Consideration of ESG Factors is fully integrated into fundamental analysis and investment decisions. The external investment manager's fundamental analysis includes an assessment of ESG Factors, alongside other financial and operational characteristics. Following the ESG-related quality assessment, the external investment manager quantifies ESG risks for these companies, to determine whether these have been accounted for, in company's valuation. The external investment manager favors issuers with better ESG characteristics where this is not detrimental to the pursuit of the investment objective.

The Sub-Fund is managed through a fundamental, bottom-up/stock picking, and business-focused approach. The objective is to identify high quality growth companies that lead attractive growth industries. The investment process begins by assessing whether a company can meet the external investment manager's six investment criteria (namely: sustainable above-average earnings growth; leadership position in a promising business space; significant competitive advantages; clear mission and value-added focus; financial strength; and rational valuation relative to the market and business prospects). Based on this preliminary review, the eligible company is placed on the external investment manager new opportunities list. At this juncture, a coverage team is established, and the business becomes subject to a deep evaluation of all relevant financial and non-financial factors, including ESG (with a specific focus on Carbon emissions).

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|--|--------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >35% |
| Thermal Coal Extraction | >10% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the External Investment Manager ESG suitability analysis.

ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

- ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The External Investment Manager will assess the good governance practices of portfolio companies which will involve assessing for issues relating to ownership and control, audit and accounting, board structure or composition, capital structure, executive compensation, employee relations, related-party transactions, shareholder protection and rights, management accountability, increasing transparency and disclosure, and the company's history of compliance with applicable regulations.



Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

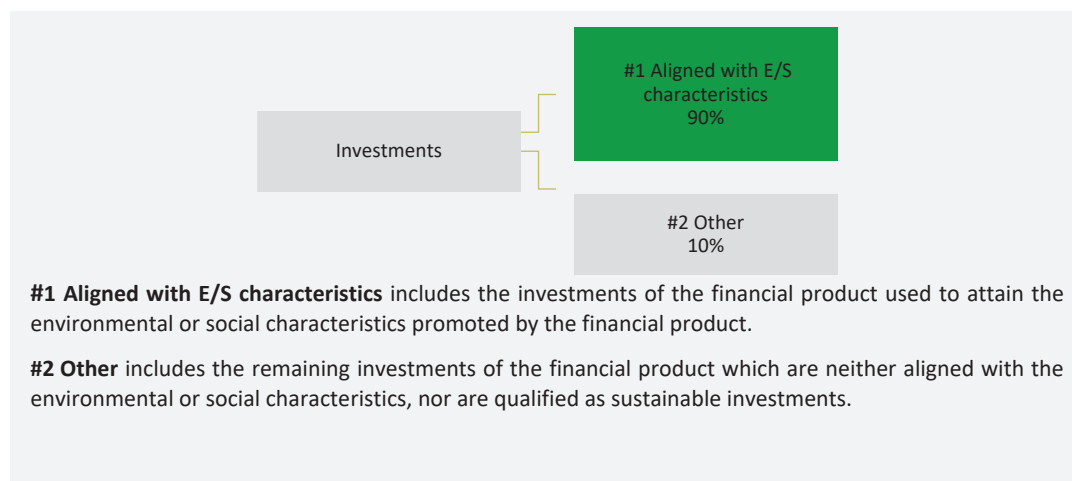
What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as "eligible" as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). "#2 Other" includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities

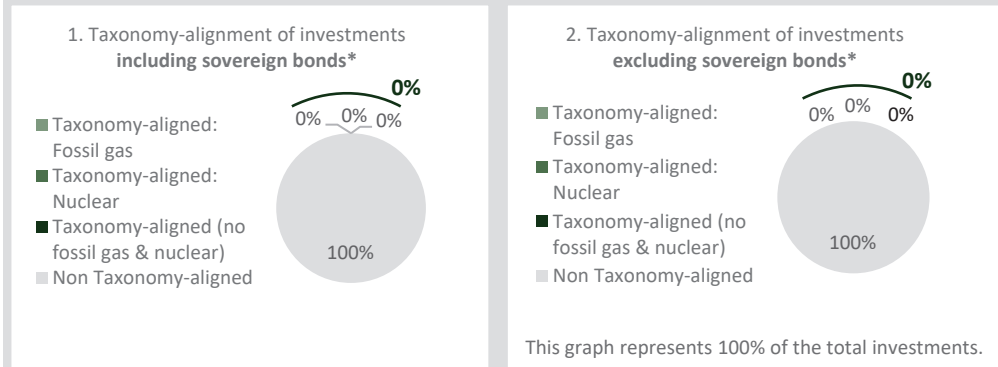
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Sands Emerging Markets Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds

Legal entity identifier:

5493003TUGS6KJRX7279

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds (the "Sub-Fund"). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the "Management Company") ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes , the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund aims to provide medium term capital appreciation with a diversified and actively managed portfolio of euro corporate bonds. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The portfolio is actively managed through a process that combines a macro themes analysis and a bottom-up security selection. The outcome portfolio aims to combine uncorrelated sources of alpha in order to mitigate risk. The security selection process of the external investment manager incorporates a disciplined and well-defined ESG best-in-class approach. The external investment manager uses its proprietary ESG assessment analysis to identify leaders, laggards and issuers with highest ESG convictions.

For credit issuers in the portfolio analysts conduct both financial analysis and ESG analysis. In financial analysis, the external investment manager analyses companies' business models from a bottom-up perspective; revenues, cost, pricing power, capital allocation and leverage as well as liquidity management play a central role. That combined with sectorial and thematic considerations drive the financial credit recommendations and positioning in the fund. Governance and management quality assessment as well as ESG risk considerations (regulation/ stranded asset/ bad governance etc) affect both fundamental and ESG analysis. Analysts express their views with a rating from 1-Improving to 4-Deteriorating.

In addition, analysts use their internal proprietary tool SustainEx to get an estimate of various social and environmental "costs" or "benefits" of companies, by using certain indicators and quantifying them positively (e.g., medicine provisions, connectivity) and negatively (e.g., water intensity, CO2 emissions) to produce an aggregate notional measure of the effect that the relevant underlying issuer has on society and the environment.

Engagement with companies is a part of the ESG analysis and fund positioning and can also be relevant for financial materiality on the fundamental side.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|--|--------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | |
|---|-----------------------|
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. The External Investment Manager will consider for inclusion into the portfolio of the Sub-Fund, companies with the top 80% ESG scores (taking the External Investment Manager’s proprietary scoring methodology).

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

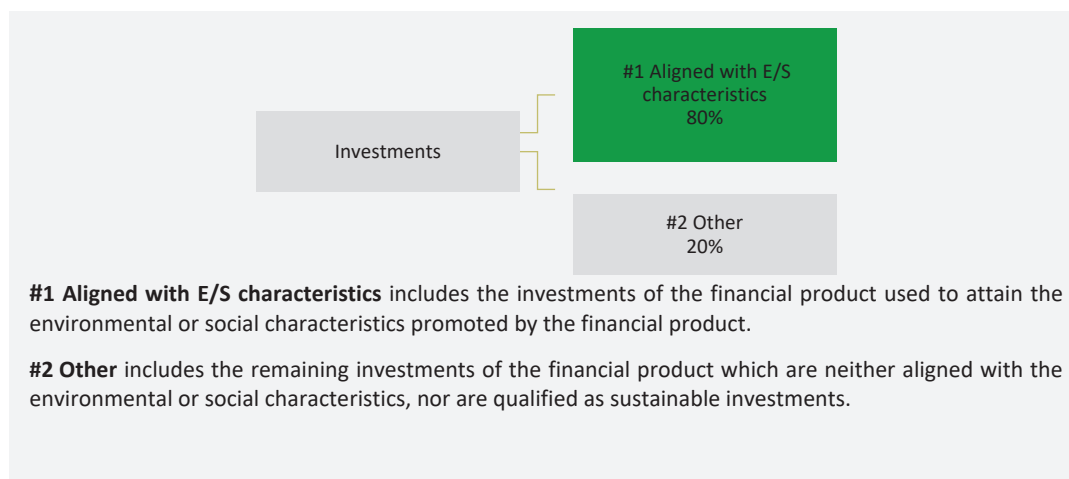
ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.



#1 Aligned with E/S characteristics includes the investments of the financial product used to attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product.

#2 Other includes the remaining investments of the financial product which are neither aligned with the environmental or social characteristics, nor are qualified as sustainable investments.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

Yes:

In fossil gas

In nuclear energy

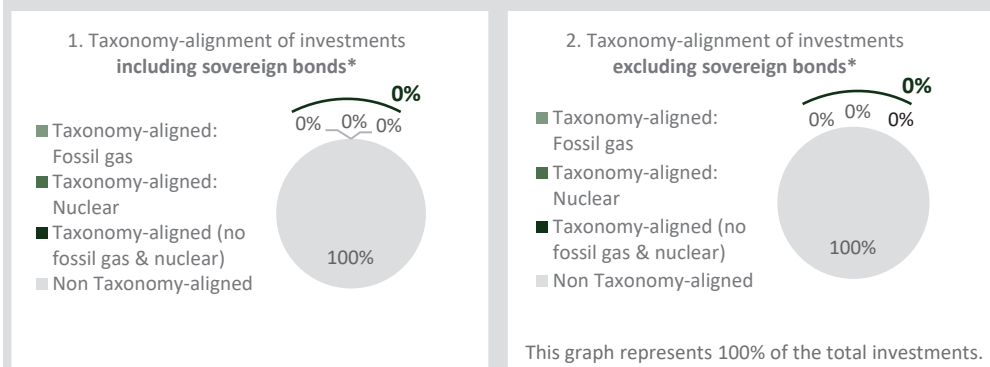
No

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***
Not Applicable
- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***
Not Applicable
- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***
Not Applicable
- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***
Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

Legal entity identifier:

549300FC4BSAZ6UXCV90

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds (the "Sub-Fund"). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the "Management Company") ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

Not Applicable

How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes , the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund aims to provide medium term capital appreciation with a diversified and actively managed portfolio of euro corporate bonds. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The portfolio is actively managed through a process that combines a macro themes analysis and a bottom-up security selection. The outcome portfolio aims to combine uncorrelated sources of alpha in order to mitigate risk. The security selection process of the external investment manager incorporates a disciplined and well-defined ESG best-in-class approach. The external investment manager uses its proprietary ESG assessment analysis to identify leaders, laggards and issuers with highest ESG convictions.

For credit issuers in the portfolio analysts conduct both financial analysis and ESG analysis. In financial analysis, the external investment manager analyses companies' business models from a bottom-up perspective; revenues, cost, pricing power, capital allocation and leverage as well as liquidity management play a central role. That combined with sectorial and thematic considerations drive the financial credit recommendations and positioning in the fund. Governance and management quality assessment as well as ESG risk considerations (regulation/ stranded asset/ bad governance etc) affect both fundamental and ESG analysis. Analysts express their views with a rating from 1-Improving to 4-Deteriorating.

In addition, analysts use their internal proprietary tool SustainEx to get an estimate of various social and environmental "costs" or "benefits" of companies, by using certain indicators and quantifying them positively (e.g., medicine provisions, connectivity) and negatively (e.g., water intensity, CO2 emissions) to produce an aggregate notional measure of the effect that the relevant underlying issuer has on society and the environment.

Engagement with companies is a part of the ESG analysis and fund positioning and can also be relevant for financial materiality on the fundamental side.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

For information, the Sub-Fund will aim to lower the duration by an equivalent of the duration of its Reference Portfolio using listed derivatives.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|--|--------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
|---|-----------------------|
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Sub-Fund will not invest in companies that do not pass the external investment manager ESG suitability analysis. The External Investment Manager will consider for inclusion into the portfolio of the Sub-Fund, companies with the top 80% ESG scores (taking the External Investment Manager’s proprietary scoring methodology).

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

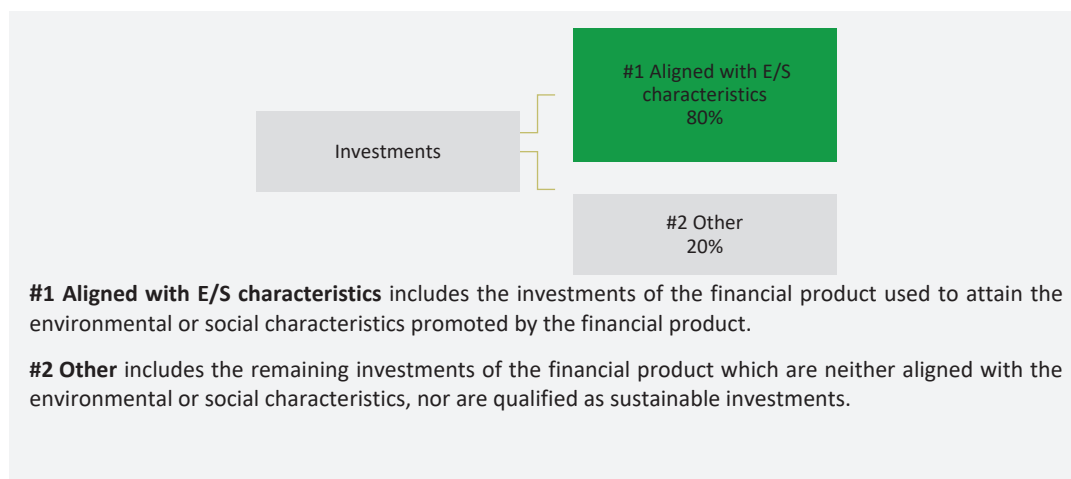
Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

Yes:

In fossil gas

In nuclear energy

No

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules.

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

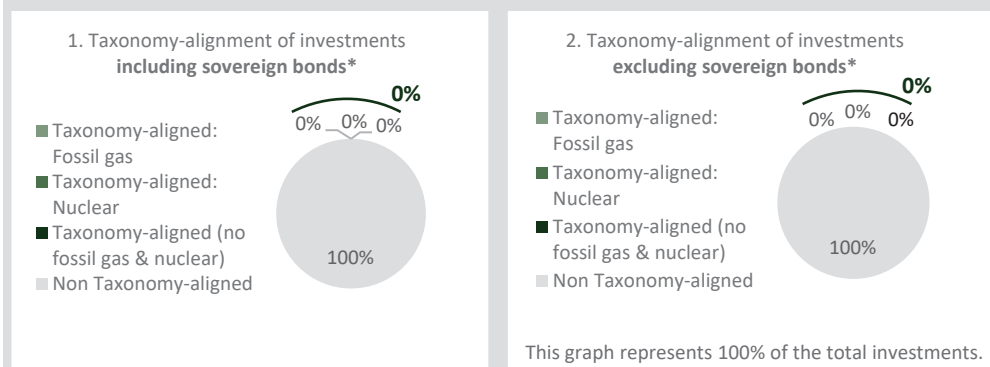
Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

ABN AMRO Funds Schroder Euro Corporate ESG Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***
Not Applicable
- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***
Not Applicable
- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***
Not Applicable
- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***
Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html)
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- [Documents of the Sub-Fund:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html)
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities

Legal entity identifier:

549300ZHDE6PGNUEWN16

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?



Yes



No



It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%



in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%



It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments



with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



with a social objective



It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities (the “Sub-Fund”). The external investment manager defines ESG integration as the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. The External Investment Managers must comply with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the External Investment Manager's corporate social responsibility policy as well as its overall

ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

sustainability strengths going from the analysis of ESG professionals, philosophy and investment process. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the External Investment Manager is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will be composed of issuers that are either leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?**

Not Applicable

- **How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?**

Not Applicable

- **How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?**

Not Applicable

- **How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:**

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- ✘ Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

The External Investment Manager's process focuses on all factors that influence the company's long-term performance, including ESG factors. The External Investment Manager's approach to ESG integration is to ensure that material factors relating to a company's integrity, sustainability and governance are integrated into the investment process (both analysis and decision-making). The objective of integrating ESG factors into the External Investment Manager's approach is to provide enhanced risk-adjusted returns over the long term. The External Investment Manager's "7 Sisters" model includes an analysis of an issuer's business operations and its interactions with key stakeholders, and is integrated into the financial management of the portfolio to enable the fund manager to identify the risks as well as the opportunities that arise from the key sustainability challenges.

The "Seven Sisters" model is based around:

- Company – History, business, divisional/geographic split, customer examples, operational footprint
- Integrity – Summary of the Integrity, Sustainability and Governance analysis.
- Market Characteristics – Size/growth/cyclicality/structure and regulation
- Control of Destiny – Market share and competitors, are they a consolidator, competitive advantage and barriers to entry, pricing power, customer/supplier concentration, substitution risk
- Financial Profile – Looks at the return structure, cash flow and the balance sheet.
- Management & Board – Experience and longevity, diversity, remuneration issues
- Valuation/Trading – Valuation, size/liquidity, available share classes.

In the analysis of integrity, sustainability and governance practices, companies are assessed and monitored on relevant and material factors across four key areas:

- 1) Environmental Considerations
- 2) Carbon Risk and Climate Change
- 3) Human and Social Capital
- 4) Governance

Engagement is central to the process. The External Investment Manager actively engages with investee companies for information and for change, addressing ESG and other issues that are material to the companies' long-term success.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- As part of the ESG inclusion selection process of the External investment Manager, are eligible for investment companies that score within the first 80% of the universe as defined by the External investment Manager ESG scoring methodology.
- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

● *What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?*

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The External Investment Manager believes that strong transparency and accountability mechanisms should lead to improved management of ESG risks and opportunities. The External Investment Manager only invests in companies considered having high standards of governance looking at its proprietary methodology. Companies are assessed and monitored across governance factors

ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

considered material to their operations. These may include board diversity, board skills and experience, board independence, succession planning, executive remuneration, employee relations, tax compliance, shareholder protection and rights, insider selling, related party transactions, uncanceled treasury stock as well as poison pills, as part of the fundamental analysis performed. Further, specific analysis of certain factors is carried out, supported with data points from a third-party provider and internally set thresholds.



Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

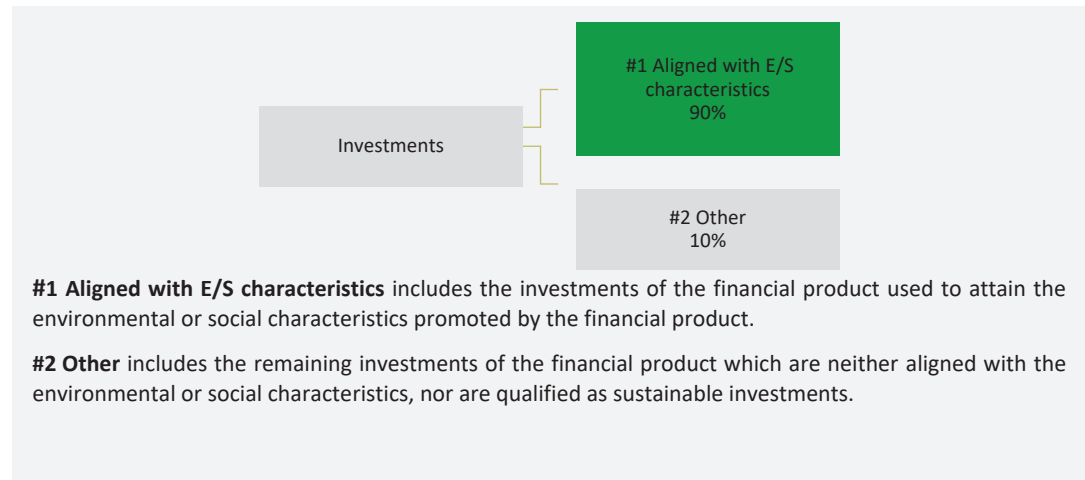
What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities

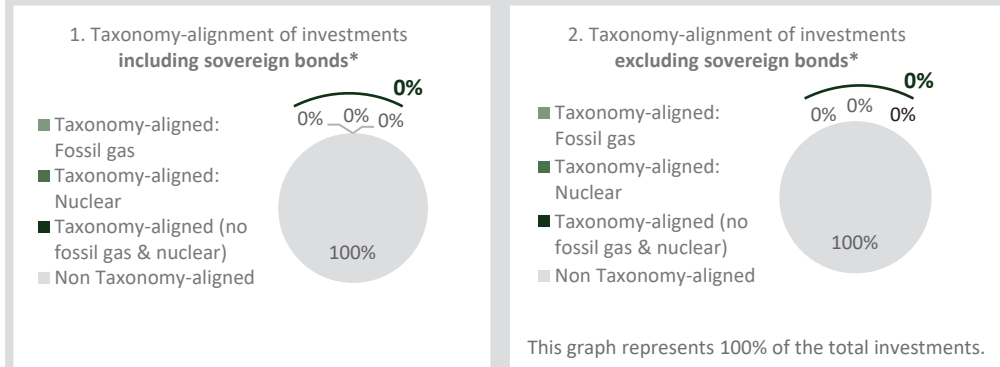
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*




* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

 **What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

 **What is the minimum share of socially sustainable investments?**

Not Applicable

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Walter Scott European ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html):
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- [Documents of the Sub-Fund](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html):
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

Legal entity identifier:

549300BP04XA5GEJQV74

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Fund of Mandate Euro Corporate Bonds (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?

Not Applicable

How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

Not Applicable

How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|--|--------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >35% |
| Thermal Coal Extraction | >10% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|--|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | | | |
|-----------------------|--|------------------------------------|---|
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The good governance requirements outlined in the SFDR are only applicable to investments in companies.



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments may not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes external funds, ETF, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.

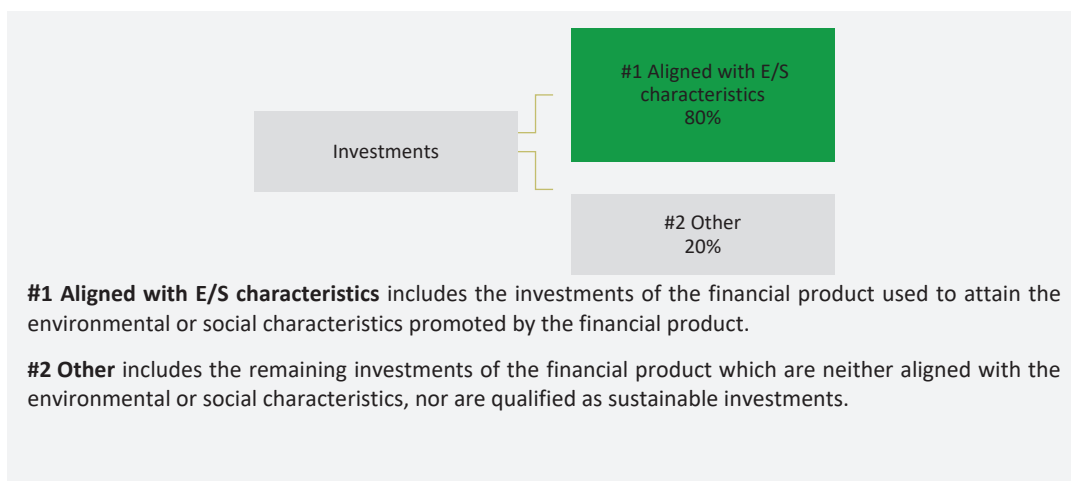
Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



#1 Aligned with E/S characteristics includes the investments of the financial product used to attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product.

#2 Other includes the remaining investments of the financial product which are neither aligned with the environmental or social characteristics, nor are qualified as sustainable investments.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

Yes:

In fossil gas

In nuclear energy

No

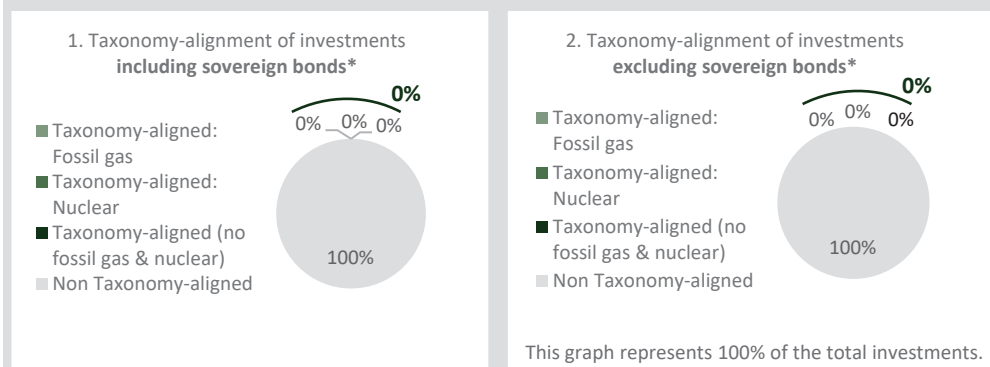
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes external funds, ETF, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Legal entity identifier:

549300S56ZBDSKD7LU52

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Fund of Mandate Euro Corporate Bonds (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?

Not Applicable

How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

Not Applicable

How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

For information, the Sub-Fund will aim to lower the duration by an equivalent of the duration of its Reference Portfolio using listed derivatives.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|--|--------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
|--|------|
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >35% |
| Thermal Coal Extraction | >10% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|--|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | | | |
|-----------------------|--|------------------------------------|---|
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

The good governance requirements outlined in the SFDR are only applicable to investments in companies.



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments may not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes external funds, ETF, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund.

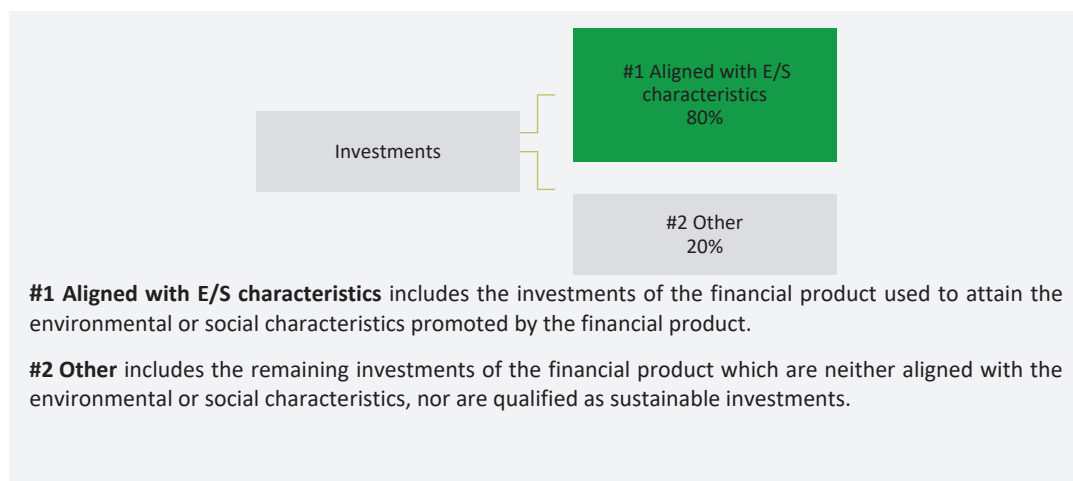
Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



#1 Aligned with E/S characteristics includes the investments of the financial product used to attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product.

#2 Other includes the remaining investments of the financial product which are neither aligned with the environmental or social characteristics, nor are qualified as sustainable investments.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

Yes:

In fossil gas

In nuclear energy

No

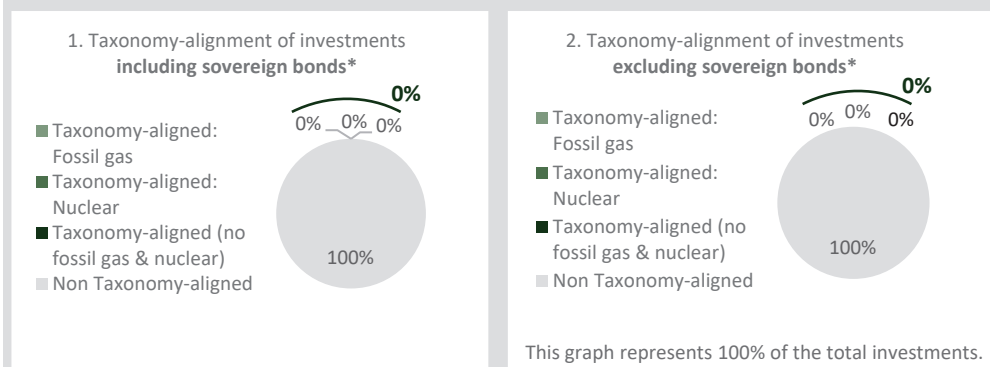
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes external funds, ETF, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

ABN AMRO Funds Fund of Mandates Euro Corporate Bonds Duration Hedged

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html)
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>

- [Documents of the Sub-Fund:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html)
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds

Legal entity identifier:

549300RYVF8K73H3B285

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

— ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

— ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company’s exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|--------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact’s Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >35% |
| Thermal Coal Extraction | >10% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU)2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.
- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

- ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds

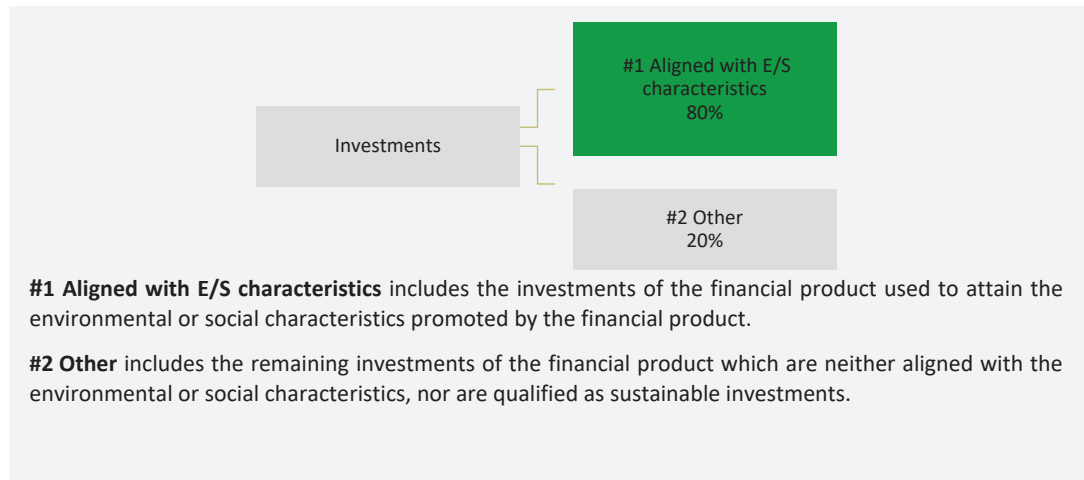
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

Yes:

In fossil gas In nuclear energy

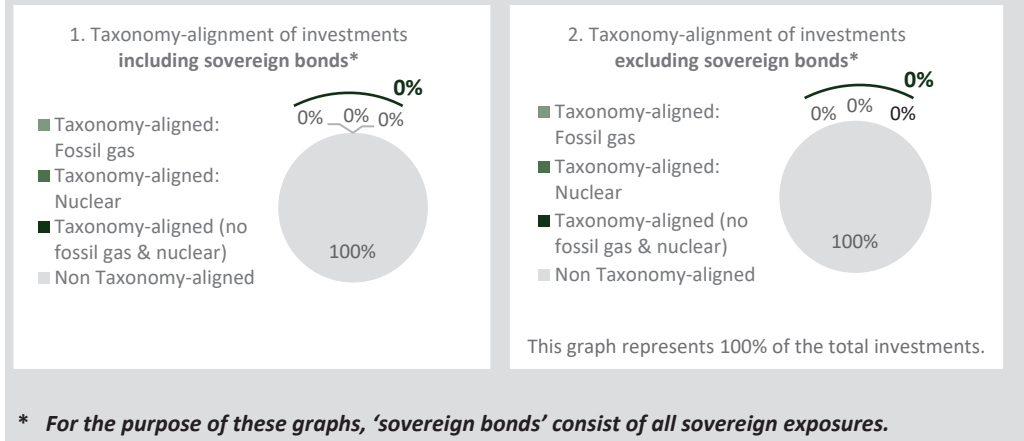
No

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***
Not Applicable
- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***
Not Applicable
- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***
Not Applicable
- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***
Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

Legal entity identifier:

549300GZOXFZT0HYCP85

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

— ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

— ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |
| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU)2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

● **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

The delegated external investment managers selected by the Management Company are committed to apply a selectivity rate of at least 20 %.

● **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

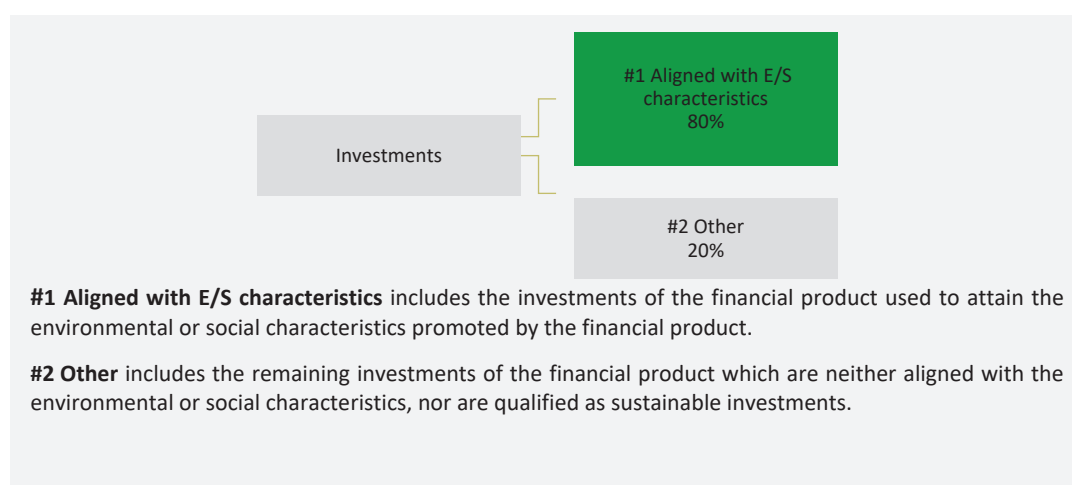
What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● *How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?*

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

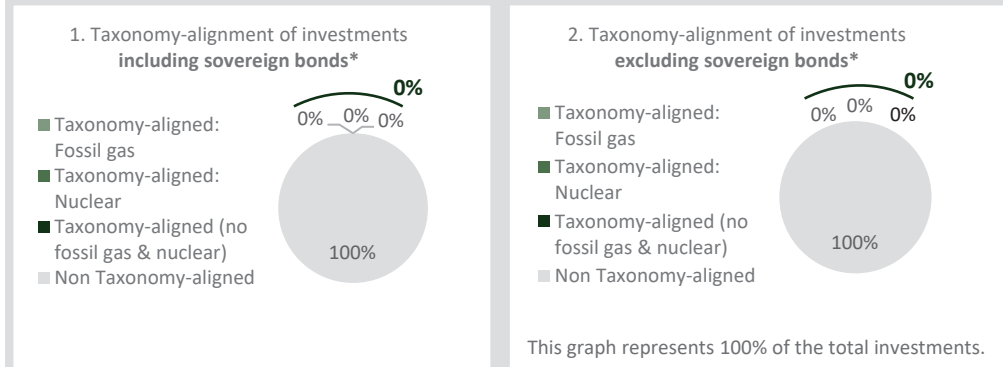
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Portfolio Flexible ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes derivatives, funds (including Exchange Traded Funds) and bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive

Legal entity identifier:

549300C3K73QSZVYCC61

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio will be

ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

composed of issuers that are leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG best-practice.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy.. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualifies as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company (i.e., applicable only to direct investments).

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |
| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

The delegated external investment managers selected by the Management Company are committed to apply a selectivity rate of at least 20 %.

- **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

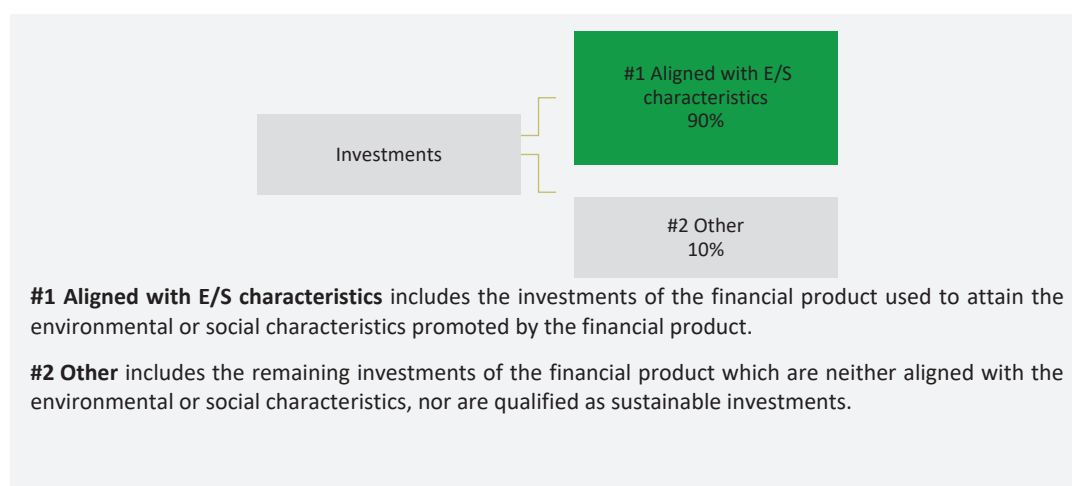


Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Consequently, up to 10% of the investments may not be aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



#1 Aligned with E/S characteristics includes the investments of the financial product used to attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product.

#2 Other includes the remaining investments of the financial product which are neither aligned with the environmental or social characteristics, nor are qualified as sustainable investments.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive

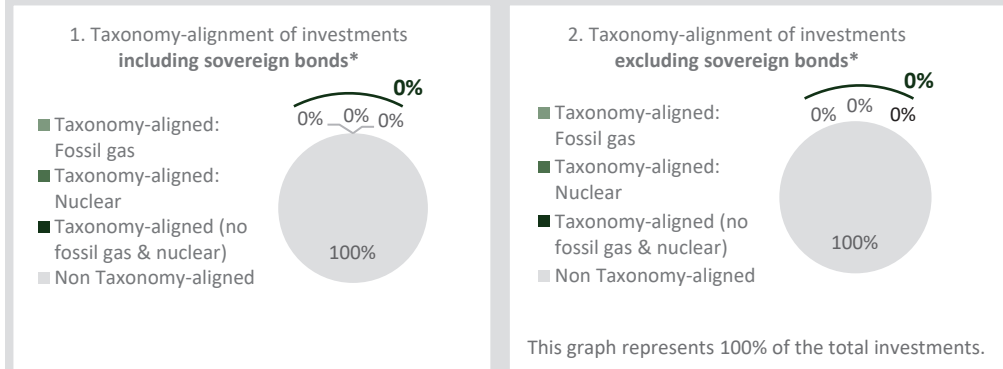
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds ESG Profile 1 – Very Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive

Legal entity identifier:

549300TMQ3X206QAK130

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance

ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

(ESG) responsibility criteria. The portfolio will be composed of issuers that are leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG best-practice.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy.. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualifies as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company (i.e., applicable only to direct investments).

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company’s exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact’s Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |
| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

● **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

The delegated external investment managers selected by the Management Company are committed to apply a selectivity rate of at least 20 %.

● **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

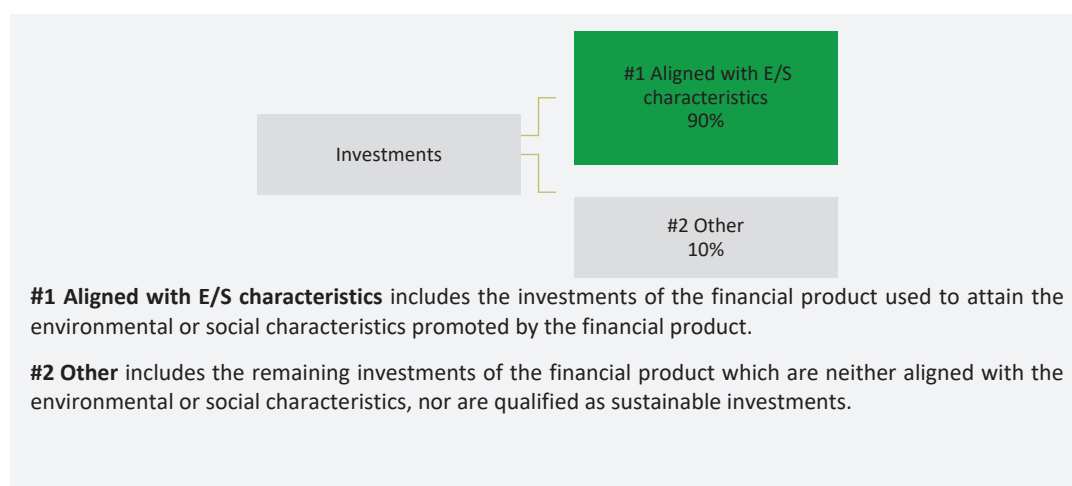


Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Consequently, up to 10% of the investments may not be aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



#1 Aligned with E/S characteristics includes the investments of the financial product used to attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product.

#2 Other includes the remaining investments of the financial product which are neither aligned with the environmental or social characteristics, nor are qualified as sustainable investments.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive

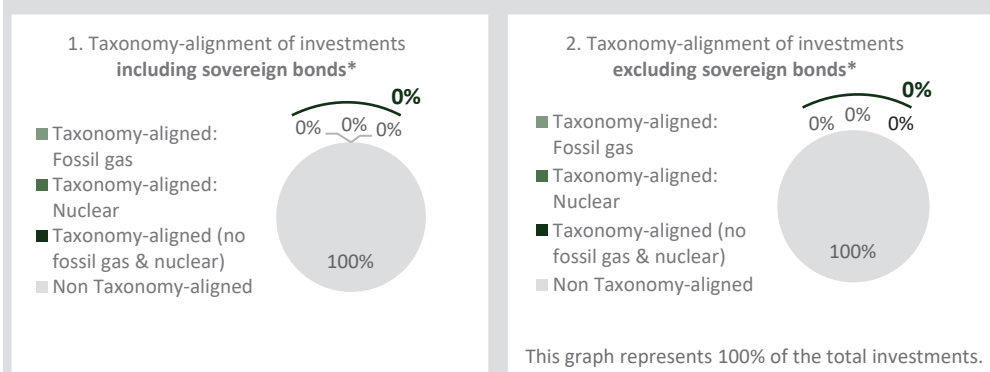
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds ESG Profile 2 – Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- **ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:**
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- **Documents of the Sub-Fund:**
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive

Legal entity identifier:

549300I5C5D9HO34B644

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio will be

ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

composed of issuers that are leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG best-practice.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy.. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualifies as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company (i.e., applicable only to direct investments).

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |
| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

● **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

The delegated external investment managers selected by the Management Company are committed to apply a selectivity rate of at least 20 %.

● **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

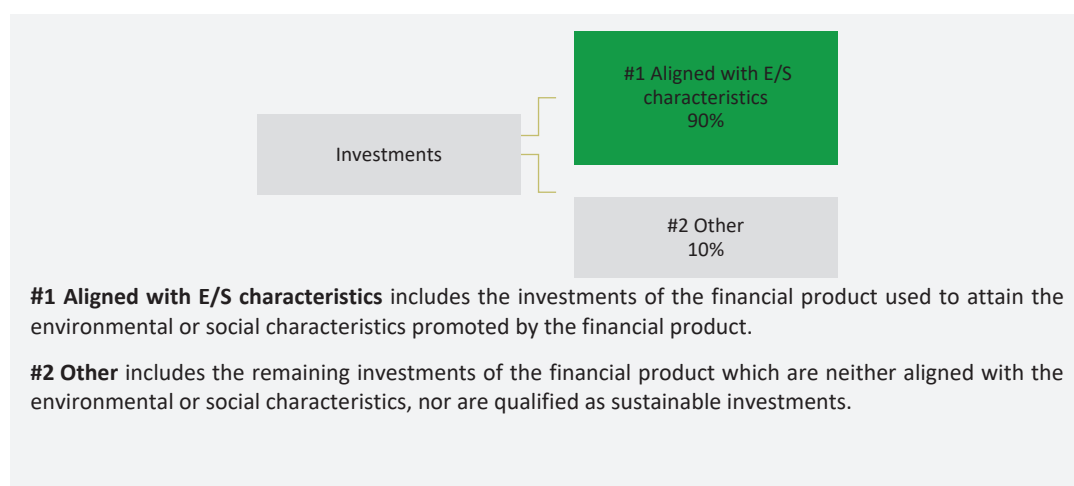


Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Consequently, up to 10% of the investments may not be aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

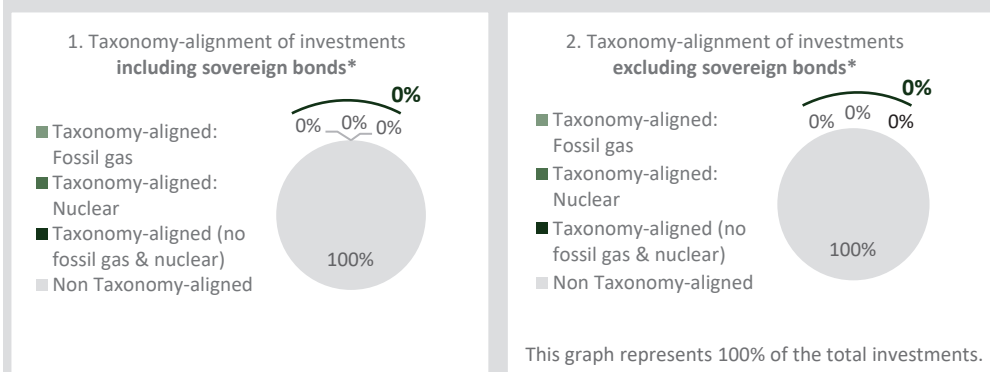
● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

Yes:

In fossil gas In nuclear energy

No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*




* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

 **What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

 **What is the minimum share of socially sustainable investments?**

Not Applicable

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds ESG Profile 3 – Moderately Defensive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive

Legal entity identifier:

54930043ILLLOXDPKX02

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio will be

ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

composed of issuers that are leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG best-practice.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

Not Applicable

How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy.. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualifies as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company (i.e., applicable only to direct investments).

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company’s exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact’s Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |
| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

The delegated external investment managers selected by the Management Company are committed to apply a selectivity rate of at least 20 %.

- **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

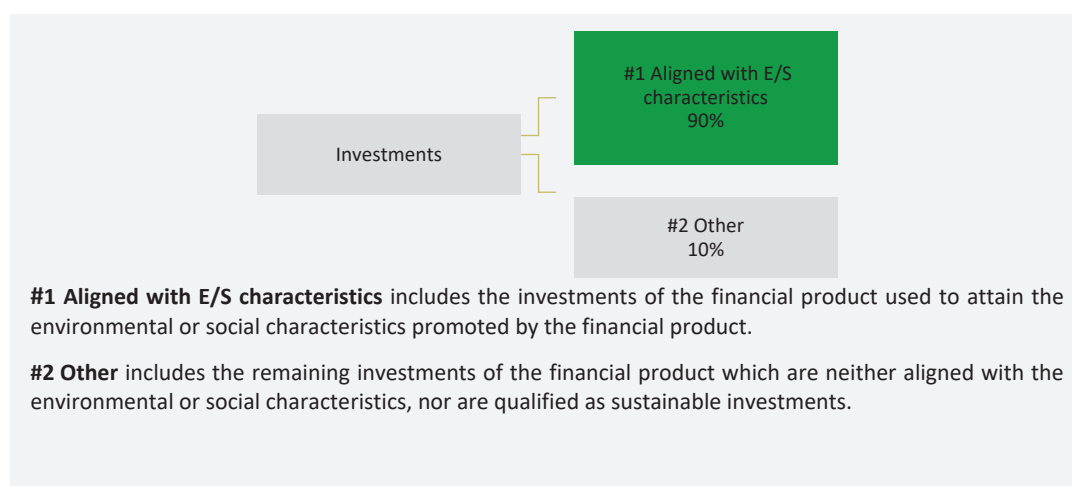


Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Consequently, up to 10% of the investments may not be aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive

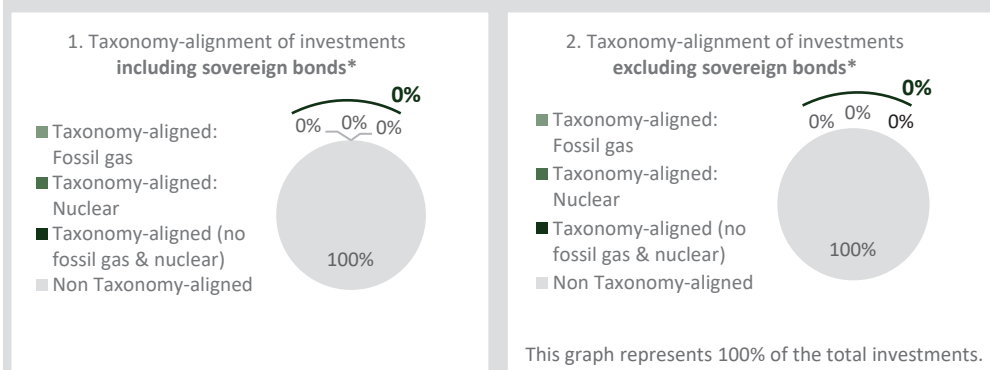
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*




* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

 **What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

 **What is the minimum share of socially sustainable investments?**

Not Applicable

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds ESG Profile 4 – Moderately Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds ESG Profile 5 –Aggressive

Legal entity identifier:

549300BW18Q0DX4OG435

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds ESG Profile 5 –Aggressive (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance

ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

(ESG) responsibility criteria. The portfolio will be composed of issuers that are leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG best-practice.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy.. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualifies as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company (i.e., applicable only to direct investments).

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company’s exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact’s Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |
| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

The delegated external investment managers selected by the Management Company are committed to apply a selectivity rate of at least 20 %.

- **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

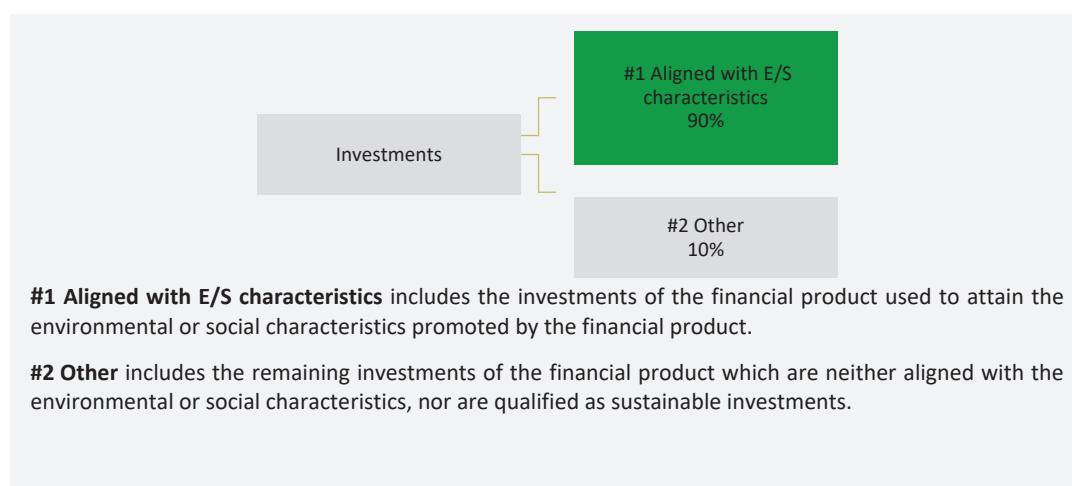


Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Consequently, up to 10% of the investments may not be aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive

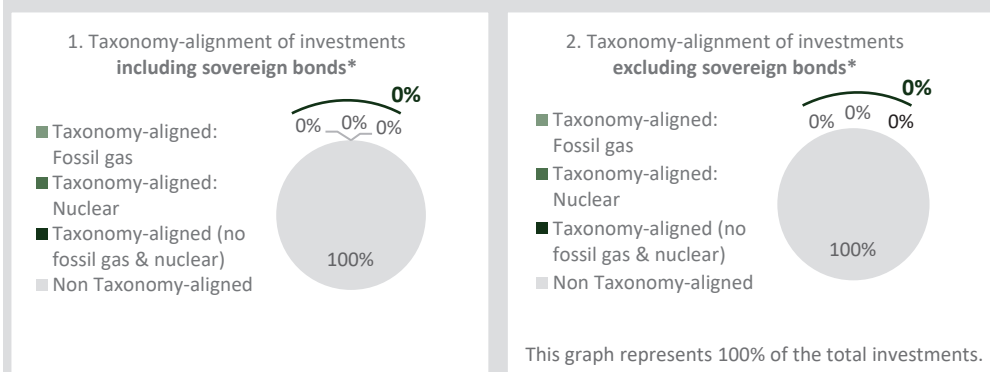
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*




* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

 **What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

 **What is the minimum share of socially sustainable investments?**

Not Applicable

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds ESG Profile 5 – Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html)
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>

- [Documents of the Sub-Fund:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html)
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive

Legal entity identifier:

549300VPXLHR3PBY3M74

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio will be

ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

composed of issuers that are leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG best-practice.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

— ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

— ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy.. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualifies as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company (i.e., applicable only to direct investments).

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company’s exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact’s Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |
| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

● **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

The delegated external investment managers selected by the Management Company are committed to apply a selectivity rate of at least 20 %.

● **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

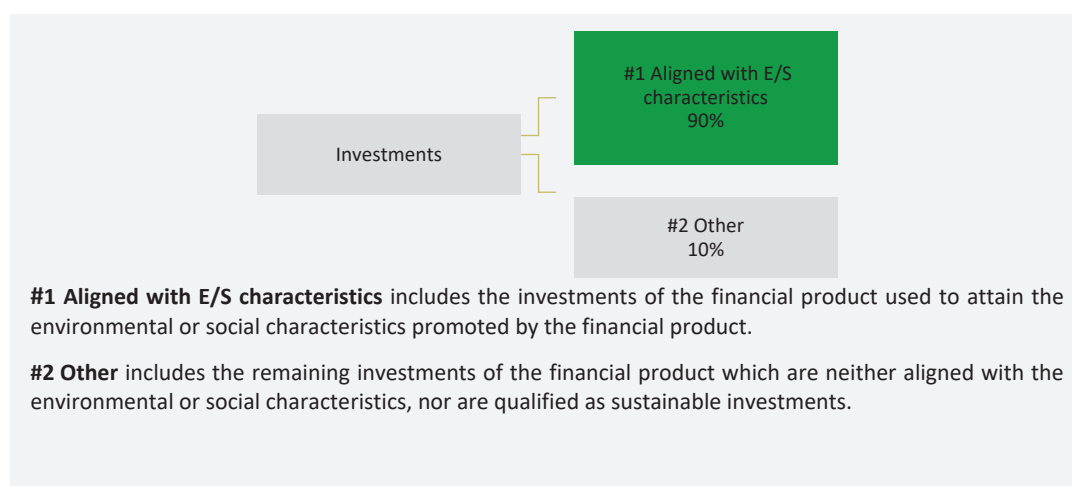


Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Consequently, up to 10% of the investments may not be aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive

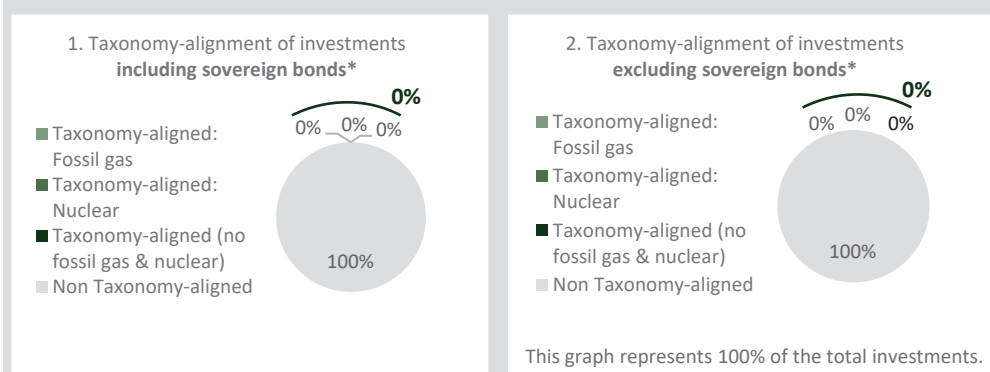
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds ESG Profile 6 – Very Aggressive

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Global Balanced

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Global Balanced

Legal entity identifier:

549300UXIM8KV62VED10

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Global Balanced (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social

ABN AMRO Funds Global Balanced

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)

ABN AMRO Funds Global Balanced

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

— ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

— ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

ABN AMRO Funds Global Balanced

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

X Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

□ No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

To select eligible securities, the Management Company performs both a financial and non-financial analysis, using ESG criteria in combination with exclusions filters.

The process of selecting the eligible securities starts with applying quantitative screens on a global universe by using the external ESG data provider Sustainalytics. These screens consist of activity-based and norm-based exclusions and ESG risk scores classification.

The purpose of the negative filters is to eliminate from investment companies that violate international standards, activities that might have a negative effect on society and on environment (as tobacco and thermal coal). The Management Company will then rank the securities according to their ESG risk score as evaluated by Sustainalytics. The purpose of the ranking is to better allocate the ESG risk score in the portfolio. The Management Company will only retain securities with an ESG risk score that is either negligible, low, medium or high. Investing in severe ESG risk score (>40) is not allowed.

Moreover, as part of the controversy assessment and using Sustainalytics as the data source provider, the Management company will exclude companies with the highest controversy score (i.e level 5-severe out of 6 levels from 0 to 5).

The Management Company may invest in external or internal funds to expose the Sub-Fund on specific market (as emerging markets, for example). Those investment funds promote environmental and social characteristics and qualifies as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector ("SFDR Article 8") or contributes to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector ("SFDR article 9"). External investment funds are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes to the capabilities in place and the portfolio construction. External

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds Global Balanced

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the “Sustainability Investment Policy” of the Management Company (i.e., applicable only to direct investments).

The management team will select the securities within the eligible universe as filtered above and will construct the portfolio based on financial criteria (top-down and bottom up) to attain the financial objectives of the fund.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

● ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company’s exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|--------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact’s Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >35% |
| Thermal Coal Extraction | >10% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- The Management Company ESG suitability criteria for investments as defined below:
 - o direct investments: only securities with an ESG risk score below 40 are eligible and a controversy level of 5 (or “severe”) based on Sustainalytics data.
 - o indirect investments: investment funds that promote environmental and social characteristics and qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or that contribute to

ABN AMRO Funds Global Balanced

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

environmental and social objectives and qualify as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services.

● **What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?**

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

● **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |

ABN AMRO Funds Global Balanced

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | | | |
|-----------------------|-----------------------------------|----------------------|--|
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

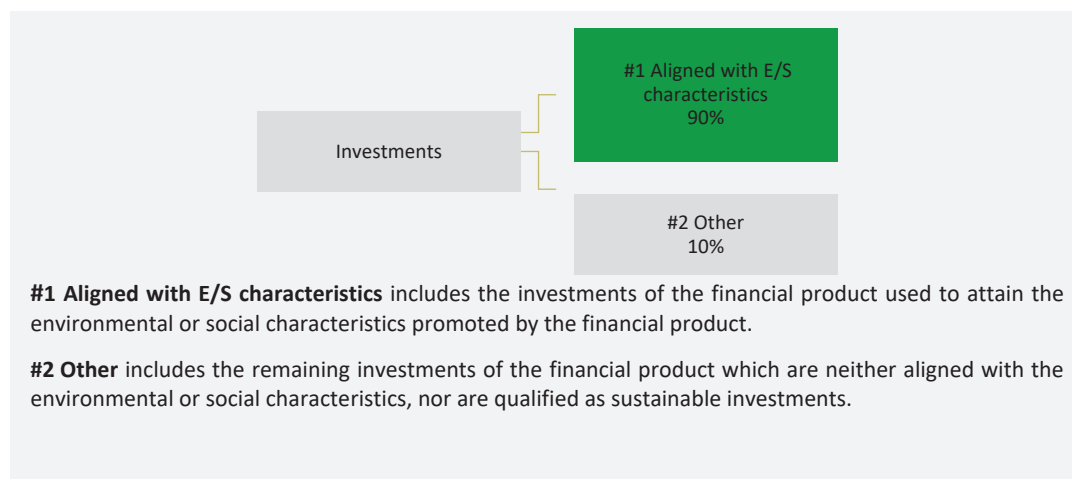
The good governance requirements outlined in the SFDR regulation are only applicable to investments in companies. Nonetheless, the external investment manager has in place a good governance methodology when it comes to consider emerging markets state-owned companies, sovereign agencies and sovereigns.



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes other funds (inc.ETF) that do classify as “SFDR Article 8” or “SFDR article 9”, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for Investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

ABN AMRO Funds Global Balanced

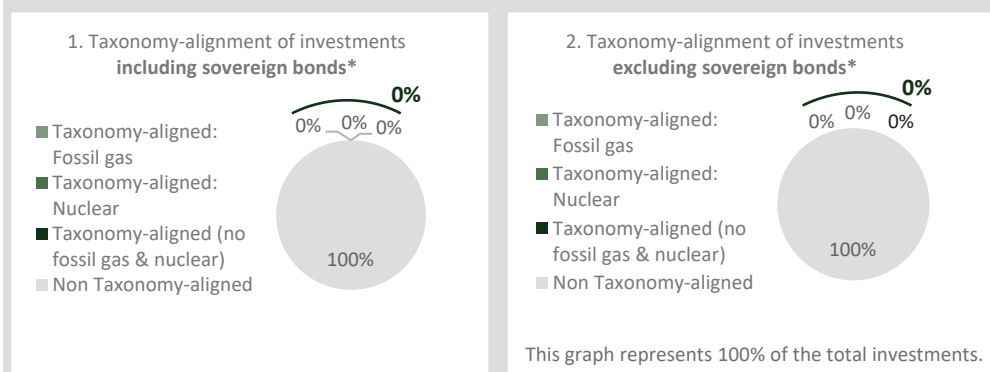
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*




* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

 **What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

 **What is the minimum share of socially sustainable investments?**

Not Applicable

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Global Balanced

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes other funds (inc.ETF) that do not classify “SFDR Article 8” or “SFDR article 9”, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

Legal entity identifier:

549300XT2IJ8JRX6BR14

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social

ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?

Not Applicable

How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

Not Applicable

How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. The Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy. Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund’s annual report.

No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|--|--------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >35% |
| Thermal Coal Extraction | >10% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |

ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|--|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |

ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | | | |
|-----------------------|--|------------------------------------|---|
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes external funds, ETF, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

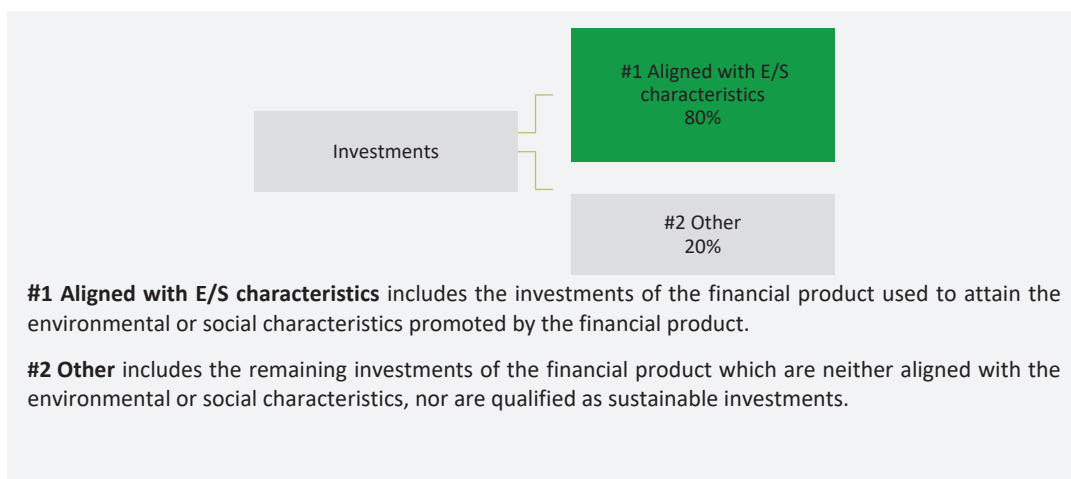
Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

Yes:
 In fossil gas In nuclear energy

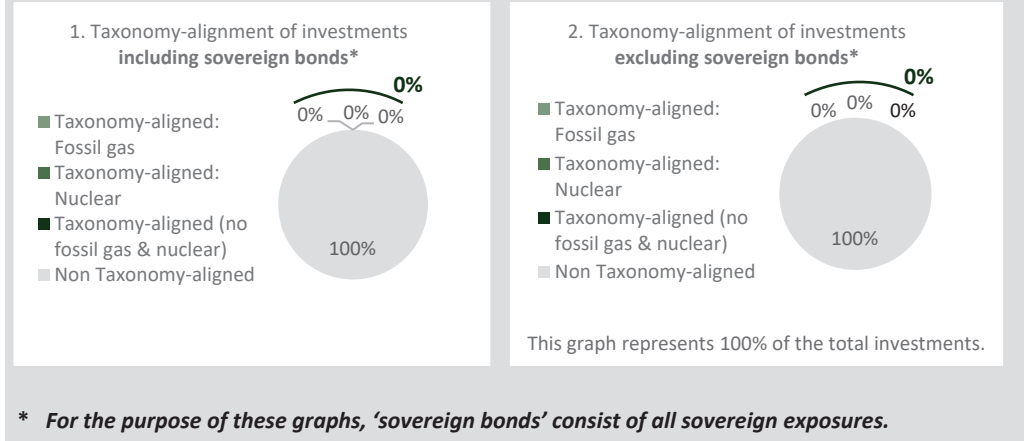
No

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes external funds, ETF, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

ABN AMRO Funds Portfolio Global Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

Legal entity identifier:

549300AC8R4PL0KWIO56

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio will be

ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

composed of issuers that are leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG best-practice.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy.. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualifies as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company (i.e., applicable only to direct investments).

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |
| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|--|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |

ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

| | | | |
|-----------------------|--|------------------------------------|---|
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.

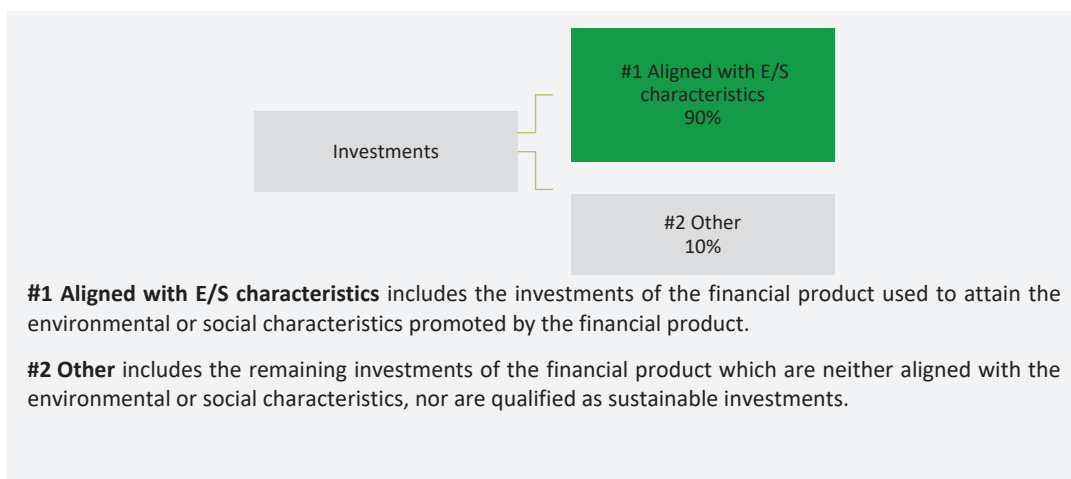
Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

Yes:

In fossil gas

In nuclear energy



No

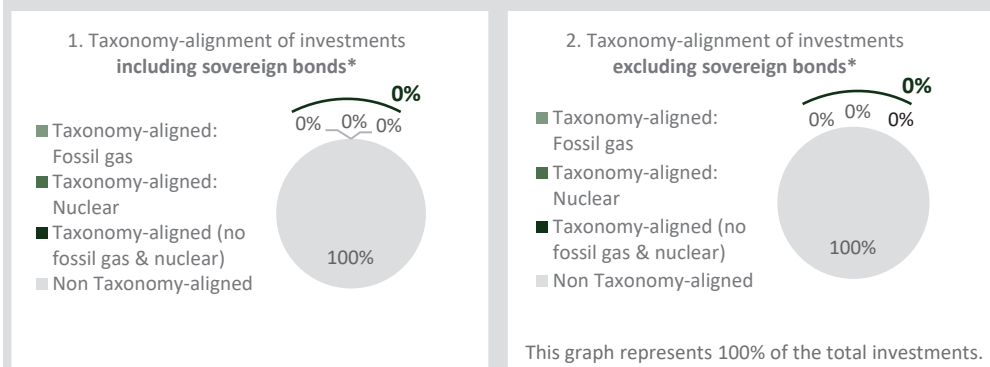
To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

ABN AMRO Funds Portfolio Global ESG Equities

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***
Not Applicable
- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***
Not Applicable
- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***
Not Applicable
- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***
Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- [ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html)
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- [Documents of the Sub-Fund:](https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html)
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds

Legal entity identifier:

549300MYXDZGOJ2JCD51

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

— ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

— ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

- No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company.

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|--------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >35% |
| Thermal Coal Extraction | >10% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.
- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

- ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its "Good Governance Policy", the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS "exclusion

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |



What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 80% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 20% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes external funds, ETF, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

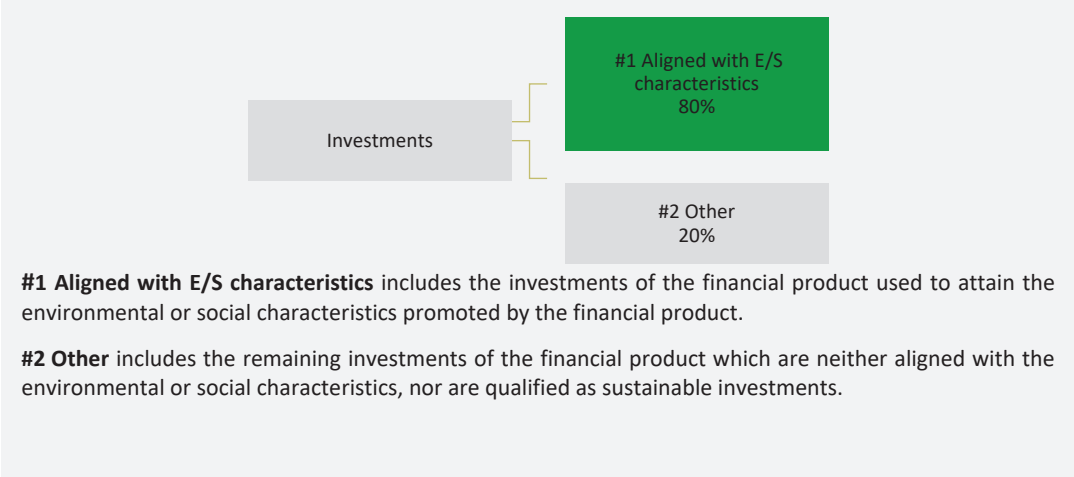
Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



- **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

Not Applicable

- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

Yes:

In fossil gas In nuclear energy

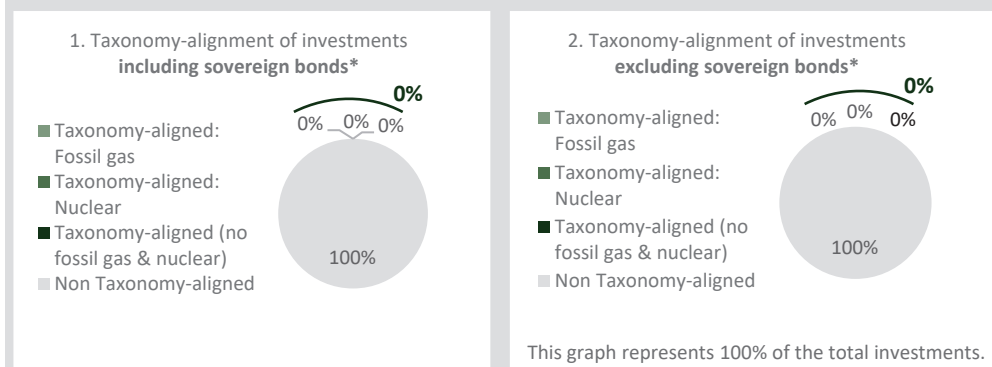
No

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes external funds, ETF, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment, hedging and efficient management portfolio purposes. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***
Not Applicable
- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***
Not Applicable
- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***
Not Applicable
- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***
Not Applicable



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution's Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

Legal entity identifier:

549300SIHSO687LWLI13

Environmental and/or social characteristics

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The analysis of ESG factors is systematically integrated into the investment decision making process of ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds (the “Sub-Fund”). ESG integration is the process of recognising the financial materiality (or significance) of environmental, social and corporate governance factors as part of the investment process. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with ABN AMRO Investment Solutions (the “Management Company”) ESG responsibility criteria. Under the ESG responsibility criteria of the Management Company, the Sub-Fund is committed to conducting both negative and positive screenings as well as taking engagement actions when necessary. The Sub-Fund will use a selection of securities complying with Environmental, Social and Governance (ESG) responsibility criteria. The portfolio will be

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

composed of issuers that are leading in ESG best-practice or attractive due to their progression in ESG best-practice.

The Sub-Fund promotes both environmental and social characteristics. On the environmental front, the Sub-Fund promotes climate risk management. The social characteristics promoted by the Sub-Fund focus on global human rights, labor standards as well as diversity, equity and inclusion.

No reference benchmark has been designated for the purpose of attaining the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund.

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

ESG analysis is systematically integrated into the investment decision making process. As part of its ESG framework, the Management Company uses the following sustainability indicators to measure the achievement of each of the environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund:

On the corporate side:

- Absence of companies that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with the E/S promotion (e.g. tobacco, controversial weapons).
- Controversy Level Assessment - Controversy involvement is a key measure of ESG performance. Controversy level assessment reflects a company's level of involvement in issues and how it manages those issues.
- Compliance with the UN Global Compact - The United Nations Global Compact is the world largest corporate sustainability initiative aimed at encouraging businesses and firms worldwide to adopt sustainable and socially responsible policies, and to report on their implementation. The UN Global Compact is a principle-based framework for businesses, stating ten principles in the areas of human rights, labour, the environment and anti-corruption. The Ten Principles of the United Nations Global Compact are derived from: the Universal Declaration of Human Rights, the International Labour Organization's Declaration on Fundamental Principles and Rights at Work, the Rio Declaration on Environment and Development, and the United Nations Convention Against Corruption.
- ESG Risk Scores - ESG risk scores measure a company's exposure to material industry-specific ESG risks and how the company manages those risks. This multi-dimensional way of measuring ESG risk combines the concepts of management and exposure to arrive at an absolute assessment of ESG risk.
- Scope 1 GHG Emissions- Scope 1 emissions emanate from a company's internal operations, including on-site energy production, vehicle fleets, manufacturing operations, and waste.
- Scope 2 GHG emissions- Scope 2 emissions are indirect emissions generated by the production of energy used by the company.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

On the Sovereign side:

- Absence of issuers that do not meet the criteria defined in the Management Company's Exclusion List and that are deemed incompatible with E/S promotion (i.e. countries listed on ABN AMRO Sanctions List, ratification of the Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons, ratification of the Paris Agreement, ratification of the ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour)
- Country Risk Scores- The Country Risk Scores measure the risk to a country's long-term prosperity and economic development by assessing how sustainably it is managing its wealth.
- Government emissions

- ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

Not Applicable

- ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Not Applicable

- ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

Not Applicable

- ***How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:***

Not Applicable

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, the Sub-Fund considers principal adverse impacts (PAI) as part of the investment decision making process. More specifically, on the corporate side, the Sub-Fund strives to minimize two PAIs by excluding (i) United Nations Global Compact non-compliant companies and (ii) controversial weapons. On the sovereign side, the Sub-Fund strives to minimize one PAI by excluding countries under international sanctions due to social violations. The Sub-Fund also strives to minimize part of the GHG intensity PAI (i.e., table 1, PAI 15) by excluding countries that have not signed the Paris Agreement.

The above principal adverse impacts are considered at product level through the exclusion policy.

Further information on principal adverse impacts will be provided in an annex to the Sub-Fund's annual report.

No

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.



What investment strategy does this financial product follow?

The Management Company may (i) delegate part of the management of the sub-funds to a minimum of two External Investment managers which are selected by the Management Company who will make investment decisions as part of the portfolio (ii) invest in units or shares of open-ended investment funds which qualify as UCITS, and/or qualify as other undertakings for collective investment (iii) manage directly the sub-funds. UCITS and delegations are selected in accordance with the Management Company's standards of quality and go through a qualitative ESG selection process before being retained. This process involves an in-depth analysis of the overall sustainability strengths going from the analysis of philosophy and investment processes.

Within the UCITS and delegations, the approaches are committed to combine a sustainability negative screening (exclusions) and a positive ESG selection investment process. The Sub-Fund's assets are predominantly allocated into investments that comply with the defined standards in respect to the promoted environmental and social characteristics and defined within the Management Company's exclusion policy.. Looking at investments in external funds, the manager will only select external funds which promote environmental and social characteristics and qualifies as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector. External funds may not apply the same set of exclusions and thus may deviate from the "Sustainability Investment Policy" of the Management Company (i.e., applicable only to direct investments).

Methodological limitations can be assessed in terms of: nature of ESG information (quantification of qualitative data), ESG coverage (some data are not available for certain issuers) and homogeneity of ESG data (methodological differences).

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The binding elements of the investment strategy are:

- The Management Company's exclusions list as defined in the following table:

| Company Exclusions based on International Standards and Policies | Exclusion Criteria |
|---|-----------------------|
| Companies non-compliant with the UN Global Compact's Principles | No |
| Companies listed on ABN AMRO Investment Exclusion List (IEL) | No |
| Companies listed on AAIS Good Governance Blacklist | No |
| Company Exclusions based on Revenue Thresholds | |
| Adult Entertainment Production | >5% |
| Controversial Weapons direct ownership | No |
| Controversial Weapons indirect ownership Involvement | >10% |
| Military Contracting Weapons | >0% |
| Military Contracting Weapons related products and /or services | >5% |
| Small Arms | >0% |
| Fur and specialty leather production | >5% |
| Unconventional fossil fuels (Arctic oil & gas exploration, oil sands and shale energy extraction methods) | Combined Revenues >5% |
| Thermal Coal Extraction | >5% |
| Thermal Coal Power Generation | >10% |
| Cannabis (recreational purposes) | >5% |
| Gambling | >5% |
| Genetically Modified Organisms | >5% |
| Tobacco Producing Companies | >0% |
| Tobacco Products Related Products/Services | >5% |
| Tobacco Products Retail and/or Distribution | >50% |
| Government Exclusions based on Norms and Policies | |
| Countries listed on ABN AMRO Sanctions List | No |
| Ratification Treaty of the Non-Proliferation of nuclear weapons (NPT) | Yes |
| Ratification Paris Agreement | Yes |
| Ratification ILO Conventions 182 on the Worst Forms of Child Labour | Yes |

The table above is a non-exhaustive set of exclusions which may evolve over time (with no prior notice).

- Investments in UCITS or delegations that qualify as an investment product in accordance with Article 8(1) of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector or fund which contribute to environmental and social objectives and qualifies as an investment product in accordance with article 9 of Regulation (EU) 2019/2088 on sustainability related disclosures in the financial services sector.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

After implementation of the investment policy described above, the committed minimum rate to reduce the scope of investment is 20 %.

- ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

As part of its “Good Governance Policy”, the Management Company of the Sub-Fund determines if a company does not follow good governance practices. Companies that do not follow good governance practices are excluded from the initial investment universe of the Sub-Fund and will fall in the Good Governance exclusion List. The Good Governance principles, integrated into the AAIS “exclusion policy” are data driven and qualitative in nature. For purposes of the Good Governance test, the Management Company has defined criteria related to widely recognized industry- established norms, as set forth below:

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

| SFDR Component | Indicator | Exclusion Criteria | Description |
|----------------------------|--|------------------------------------|---|
| Sound Management Structure | UN Global Compact - Principle 10 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 10 of the UN Global Compact is related to anti-bribery and corruption and states businesses should work against corruption in all its forms, including extortion and bribery. |
| | Governance controversy assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: accounting irregularities, bribery and corruption, anti-competitive practices, sanctions as well as board composition. |
| Employee Relations | UN Global Compact – Principles 3, 4, 5 and 6 | Watchlist and Non-Compliant status | Principle 3, 4, 5 and 6 of the UN Global Compact are related to labour conditions. The principles state that businesses should uphold the freedom of association and the effective recognition of the right to collective bargaining; the elimination of all forms of forced and compulsory labour; the effective abolition of child labour; and the elimination of discrimination in respect of employment and occupation. |
| | Social Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, the following topics are included: freedom of association, child/forced labour, health and safety, community relations, respect of human rights, labour standards, discrimination and harassment. |
| Tax Compliance | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, taxes avoidance and evasion are taken into consideration. |
| Remuneration of Staff | Governance Controversy Assessment | High & Severe Levels | As part of the controversy assessment, remuneration is taken into consideration. |

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

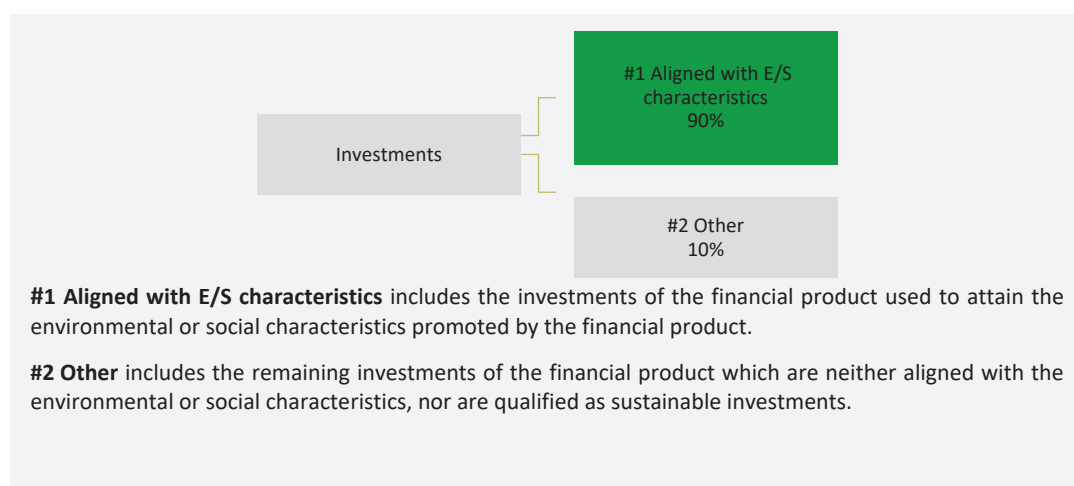
What is the asset allocation planned for this financial product?

The Sub-Fund invests at least 90% of its net assets in assets that have been determined as “eligible” as per the ESG process in place (hence in investments that are aligned with the promoted environmental and social characteristics (#1 Aligned with E/S characteristics).

Up to 10% of the investments are not aligned with these characteristics (#2 Other). “#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Not Applicable



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

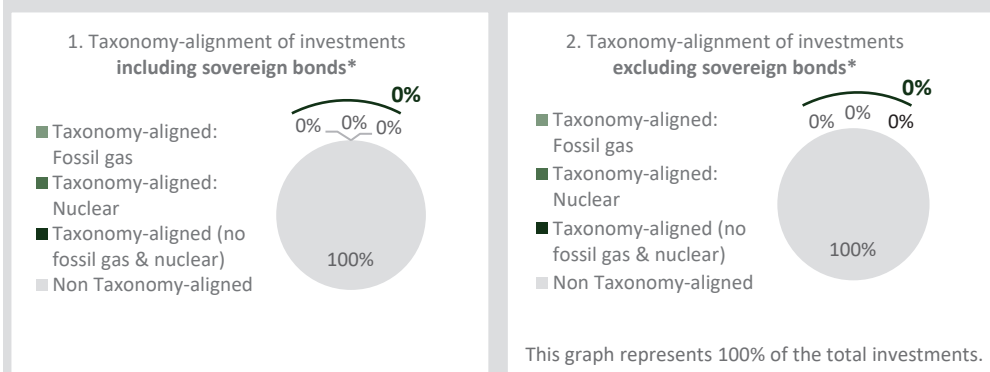
Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

To comply with the EU Taxonomy, the criteria for **fossil gas** include limitations on emissions and switching to renewable power or low-carbon fuels by the end of 2035. For **nuclear energy**, the criteria include comprehensive safety and waste management rules. **Enabling activities** directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective. **Transitional activities** are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund does not have a minimum share of investments in transitional and enabling activities (i.e., 0%), as it does not commit to a minimum proportion of environmentally sustainable investments aligned with the EU Taxonomy.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

Not Applicable



What is the minimum share of socially sustainable investments?

Not Applicable

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective - see explanatory note in the left hand margin. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

ABN AMRO Funds Portfolio High Quality ESG Bonds

Pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

“#2 Other” includes delegated external investment managers assets that qualify as Article 8 as defined by the Management Company’s Sustainable Investment Policy, derivatives, bank deposits at sight, including cash held in current accounts with a bank accessible at any time. These are used for investment or hedging or efficient management portfolio purposes. A more detailed description of the specific asset allocation of this Sub-Fund can be found in the prospectus of this Sub-Fund. There are no minimum environmental or social safeguards associated with these investments.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

No specific ESG-related index has been designated for this Sub-Fund.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Not Applicable

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

Not Applicable

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Not Applicable

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Not Applicable

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the websites:

- ABN AMRO Investment Solution’s Sustainable Investment Policy:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/socially-responsible-investment-abn-amro-investment-solutions/sustainability-related-disclosures.html>
- Documents of the Sub-Fund:
<https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/fund-range/fund-range.html>

