

## Præ-kontraktuel rapportering på PP Capital BASIS

### 1. Hvilke miljømæssige og/eller sociale karakteristika fremmes i dette finansielle produkt?

PP Capital ønsker med PP Capital BASIS (PPC BASIS) at fremme miljømæssige karakteristika ved et reduceret miljøaftryk relativt til det udvalgte benchmark. Fonden anvender ikke et finansielt benchmark, og derfor er NASDAQ Global Large Mid Cap udvalgt som sammenligningsgrundlag for bæredygtighed for PPC BASIS' aktieportefølje.

#### *Hvilke bæredygtighedsindikatorer bruges til at måle opnåelsen af de miljømæssige eller sociale karakteristika, der fremmes af dette finansielle produkt?*

Opnåelsen af de miljømæssige karakteristika måles på følgende metrikker for den samlede portefølje:

- CO2-udledning (scope 1 og 2)
- Beholdning af fossile brændstofreserver
- Vandforbrug
- Generering af affald

Porteføljens miljøaftryk sammenlignes med benchmark, og blev i 2020 rebalanceret med fokus på at have et mindre aftryk pr. millioner euro investeret på alle 4 metrikker, samt at have lavere eksponering over for investeringer i kontroversielle emner som produktion af våben, tobak og fossile brændstoffer.

### 2. Hvilken investeringsstrategi følger dette finansielle produkt?

PPC BASIS er en balanceret portefølje investeret i forskellige aktivklasser, herunder både aktier, obligationer og alternativer. Strategien hviler på en aktiv forvaltning, hvori andelen af aktier øges under økonomisk opsving, mens der i økonomisk dårlige perioder rebalanceres til en øget beholdning af obligationer.

#### **Hvad er de bindende elementer i investeringsstrategien, der bruges til at vælge investeringerne for at opnå hver af de miljømæssige eller sociale karakteristika, der fremmes af dette finansielle produkt?**

Produktet PPC BASIS har ingen bindende elementer i investeringsstrategien til anvendelse mod at opnå de miljømæssige karakteristika, som produktet fremmer.

#### **Hvordan implementeres strategien løbende i investeringsprocessen?**

Investeringsstrategien for PPC BASIS er baseret på løbende aktivallokering baseret på økonomiske konjunkturer. PPC BASIS definerer hertil 4 forskellige faser i markedsøkonomien, som afgør fordelingen af de forskellige aktiver.

- Fase 1 'Expansion':
  - Karakteriserer opadgående tendens i økonomien
  - I denne periode øges beholdningen af aktier
- Fase 2 'Slowdown':

- Karakteriserer tider med aftagende økonomisk vækst
- Porteføljen justeres ved at øge beholdningen af obligationer
- Fase 3 'Downturn':
  - Karakteriserer et faldende aktiemarked
  - PPC BASIS risikojusteres her ved at øge andelen af obligationer og alternativer yderligere
- Fase 4 "Recovery":
  - Karakteriserer en positiv stigning i det globale finansielle marked
  - Aktiebeholdningen øges på ny

PP Capital udarbejder løbende økonomiske prognoser af markedet, med formålet at forudse markedets kommende fase.

***Er der forud for anvendelse af investeringsstrategien fastsat en minimumsforpligtelse for reducere af det investerbare univers?***

Der er ingen minimumsforpligtelse i forhold til at reducere omfanget af investeringer forud for anvendelse af den nævnte investeringsstrategi.

***Hvor kan jeg finde yderligere oplysninger om investeringsstrategien?***

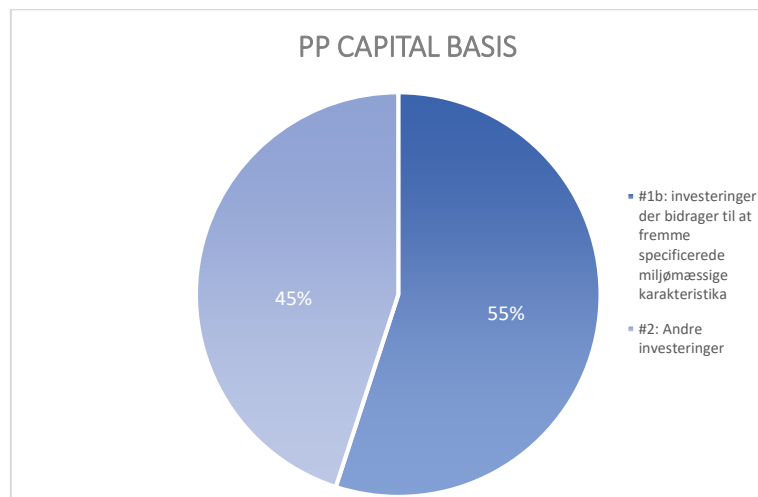
Yderligere oplysninger om investeringsstrategien for BASIS kan findes i strategiens [prospekt](#).

**3. Hvad er den planlagte aktivfordeling for dette finansielle produkt?**

PPC BASIS investerer i 4 forskellige aktiver: Aktier, obligationer, alternativer og kontanter. Disse 4 aktivklasser er valgt således at der aktivt kan øges eller mindskes beholdninger af hver enkelt type aktiv afhængig af den økonomiske fase hvori markedet befinder sig. I denne fase fremmer PPC BASIS miljømæssige karakteristika ved et mindre miljøaftryk end udvalgte benchmark.

Aktier udgør i den nuværende fase 'Downturn' 55% af porteføljens beholdning, hvoraf følgende fordeling gælder:

- #1A: bæredygtige Investeringer udgør 0% af beholdningen
- 1B: Investeringer, der bidrager til at fremme specificerede miljømæssige karakteristika udgør 100% af aktiebeholdningen, og derved 55% af den samlede portefølje.



## **Hvilke investeringer er inkluderet under "#2 Andet", hvad er deres formål, og er der miljømæssige eller sociale minimumsgarantier?**

- Aktivklasserne inkluderet under "#2 Andet" består af obligationer, kontanter og alternativer.
- Der er ingen forudbestemte miljømæssige eller sociale minimumsgarantier for andre aktivklasser end aktier.

## **Hvordan anvendes finansielle derivativer til at fremme miljømæssige og sociale karakteristika?**

Finansielle derivativer anvendes på nuværende tidspunkt ikke til at fremme miljømæssige eller sociale karakteristika.

## **Hvordan vil de bæredygtige investeringer bidrage til ESG-formål uden væsentligt at modarbejde (Do no significant harm) andre bæredygtigheds mål?**

PPC BASIS indeholder ikke aktier, der karakteriseres som bæredygtige investeringer. Der er derfor heller ikke taget højde for hvordan investeringerne enkeltvis bidrager til bæredygtigheds mål uden at overtræde DNSH-princippet.

- **Hvordan tages der hensyn til indikatorer for negative indvirkning på bæredygtighedsfaktorer?**

Der tages hensyn til følgende metrikker, der kan karakteriseres som negative indvirkning på bæredygtighed:

- CO2-udledning (scope 1 og 2)
- Beholdning af fossile brændstofferreserver
- Vandforbrug
- Generering af affald

Porteføljen blev i 2020 rebalanceret med fokus på at have et mindre aftryk pr. millioner euro investeret på alle 4 metrikker, samt at have lavere eksponering over for investeringer i kontroversielle emner som produktion af våben, tobak og fossile brændstoffer.

- **Er bæredygtige investeringer tilpasset OECD's Retningslinjer for Multinationale Virksomheder og FN's Retningslinjer for Menneskerettigheder og Erhverv?**
  - PPC BASIS indeholder ikke aktier, der afgrænses som bæredygtige investeringer, hvortil der ligeledes ikke tages højde for OECD's retningslinjer for Multinationale virksomheder og FN's retningslinjer for Menneskerettigheder og Erhverv.

## **4. Tager dette produkt hensyn til de væsentligste negative virkninger på bæredygtighedsfaktorer? (Yes/No)**

Der tages hensyn til følgende metrikker, der kan karakteriseres som negative indvirkning på bæredygtighed:

- CO2-udledning (scope 1 og 2)

- Beholdning af fossile brændstofreserver
- Vandforbrug
- Generering af affald

Porteføljen blev i 2020 rebalanceret med fokus på at have et mindre aftryk pr. millioner euro investeret på alle 4 metrikker, samt at have lavere eksponering over for investeringer i kontroversielle emner som produktion af våben, tobak og fossile brændstoffer.

**5. Kan jeg finde mere produktspecifik information online? (hyperlink to website)**

Ja, mere information om PP Capital BASIS findes på [PP Capitals hjemmeside](#).

**6. Er et specifikt indeks udpeget som et reference benchmark til at afgøre, om dette finansielle produkt er tilpasset de miljømæssige eller sociale karakteristika, det fremmer?**

Nej.