

## Neuberger Berman CLO Income Fund

Salkku luokitellaan SFDR-asetuksen 8 artiklan mukaiseksi rahoitustuotteeksi.

Osana sijoitusprosessia sijoitustiimi edistää useita ympäristöön ja yhteiskuntaan liittyviä ominaisuuksia, jotka kuvataan jäljempänä. Näitä ympäristöön tai yhteiskuntaan liittyviä ominaisuuksia edistetään varmistamalla, että Salkun hallussa olevien lainavakuudellisten velkasitoumusten ("CLO") vakuutena olevilla arvopapereilla on NB-luokitus (kuvattu alla). NB ESG Quotient -arviointi perustuu sektorikohtaisten, taloudellisesti merkittävien ympäristöön, yhteiskuntaan tai hallintotapaan liittyvien riskien ja mahdollisuuksien käsitteeseen, joka huomioidaan kaikkien CLO-arvopapereiden vakuuksien osalta.

### Ei kestävää sijoitustavoitetta

Salkku edistää ympäristöön ja/tai yhteiskuntaan liittyviä ominaisuuksia, mutta kestävä sijoittaminen ei ole sen tavoite.

### Salkun edistämät ympäristöön tai yhteiskuntaan liittyvät ominaisuudet

Salkku edistää seuraavia ympäristöön tai yhteiskuntaan liittyviä ominaisuuksia CLO-arvopapereiden vakuuksien tasolla:

**Ympäristöön liittyvät ominaisuudet:** ilmasto, kasvihuonekaasupäästöt ja maailmanlaajuinen saastuminen, vaikutus maastoon, ekosysteemeihin ja biodiversiteettiin sekä

**Yhteiskuntaan liittyvät ominaisuudet:** lapsityövoima; korruptio, lahjonta, kiristys ja rahanpesu; pakkotyö; ihmisoikeusloukkaukset ja yritysten vaikutus; työterveys ja -turvallisuus.

### Sijoitusstrategia

Salkun tavoitteena on saavuttaa 4–5 prosentin keskimääräinen tuotto, joka ylittää vertailuarvona käytetyn ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD) -indeksin markkinajaksolla (tyypillisesti vähintään 3 vuotta) sijoittamalla pääasiassa Yhdysvaltain dollarin ja euron määräisiin vaihtuvakorkoisiin välirahoitettuihin CLO-velkakirjoihin sekä Yhdysvaltain korkeatuottoisiin velkakirjoihin, jotka on noteerattu tai joilla käydään kauppaa tunnustetuilla markkinoilla.

### Sijoitusten osuus

Salkun tavoitteena on omistaa suoraan vähintään 60 prosenttia sijoituksista, jotka sopivat yhteen salkun edistämien ympäristöön ja yhteiskuntaan liittyvien ominaisuuksien kanssa. Salkku ei sitoudu omistamaan kestäviä sijoituksia.

### Ympäristöön tai yhteiskuntaan liittyvien ominaisuuksien seuranta

Sijoitustiimi ottaa huomioon useita kestävyysindikaattoreita mitatessaan salkun edistämiä ympäristöön ja/tai yhteiskuntaan liittyviä ominaisuuksia CLO-arvopapereiden vakuuksien tasolla, mukaan lukien

- I. NB-luokitus ja
- II. Välttämiskriteerit ja osallistumiskäytännöt.

### Menetelmät ympäristöön tai yhteiskuntaan liittyviä ominaisuuksia varten

Sijoitustiimi seuraa ja raportoi edellä kuvattujen kestävyysindikaattoreiden kehitystä. Näitä kestävyysindikaattoreita käytetään mittaamaan salkun edistämien ympäristöön ja yhteiskuntaan liittyvien ominaisuuksien saavuttamista ja ne sisällytetään salkun pakollisiin kausiraportteihin.

|                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|---------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>Tietolähteet ja tietojen käsittely</b>         | ESG-tietojen ja analyysitietojen lähtöaineistot saadaan hyödyntämällä omia sijoitustyökaluja ja sisäistä tutkimusta (joka sisällyttää prosessiin kriittisen ajattelun ja inhimillisen päätöksenteon) sekä useita tietolähteitä, kuten kansainvälisiä rahoituslaitoksia, ulkopuolisia tietopalvelujen tarjoajia, yritysten suoraan antamia tietoja, yritysten välillisesti antamia tietoja, kehitystoimistoja sekä erikoisalojen selvityksiä tarjoavia palveluntarjoajia.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| <b>Menetelmiä ja tietoja koskevat rajoitukset</b> | Menetelmillä ja tiedoilla voi olla esimerkiksi seuraavia rajoituksia: tietojen toimittajien menetelmien standardoinnin puute; yritysten raportointistandardien puutteellisuus sekä yhteensopimattomuus palveluntarjoajien toimittamien ESG-tietojen kanssa; epäjohtonmukaisuudet palveluntarjoajien käyttämässä ESG-tietojen raportointimenetelmissä sekä tiedoissa, joiden perusteella kolmannet osapuolet tuottavat mittarinsa; epäjohtonmukaisuudet konsernirakenteissa ja oikeushenkilötunnuksissa voivat aiheuttaa epäjohtonmukaisuuksia tietojen toimittajien tavoissa kohdistaa ja yhdistää ESG-tietoaaineistoja arvopapereihin; yritysten, erityisesti yksityisten yritysten ja kehittyville markkinoille sijoittautuneiden yritysten, vähäinen määrä tiettyjen indikaattoreiden ja omaisuusluokkien kohdalla; eroavaisuudet tietojen laadussa ja kattavuudessa yksityisten markkinoiden (velka ja pääomasijoitukset) osalta; joidenkin tietojoukkojen raportoinnissa voi olla huomattavia viiveitä ja osa kolmansilta osapuolilta saatavilla olevista tiedoista on laskettu korvaavien tai arvioitujen tietojen perusteella. Neuberger Berman on vakuuttunut, että SFDR-asetuksen 8 tai 9 artiklan mukaiseksi luokiteltujen rahoitustuotteiden osalta tällaiset rajoitukset eivät vaikuta ympäristöön tai yhteiskuntaan liittyvien ominaisuuksien edistämiseen tai sen kestävän sijoitustavoitteen saavuttamiseen, johon kyseinen rahoitustuote on sitoutunut. |
| <b>Asianmukainen huolellisuus</b>                 | Ennen sijoituksen tekemistä Neuberger Berman toteuttaa kohtuullisen ja asianmukaisen huolellisen arvioinnin kuhunkin sijoitukseen sovellettavien tosiseikkojen ja olosuhteiden perusteella.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| <b>Vaikuttamispoliitikat</b>                      | Vaikuttaminen on salkun sijoitusprosessin tärkeä osa.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| <b>Nimetty vertailuarvo</b>                       | –                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |

Päivitetty viimeksi: 1.7.2025