

Neuberger Berman CLO Income Fund

Porteføljen kategoriseres som et finansielt produkt jf. artikel 8 i medfør af SFDR.

Som en del af investeringsprocessen fremmer investeringsteamet en række miljømæssige og sociale karakteristika som angivet herunder. Disse miljømæssige og sociale karakteristika fremmes ved at sikre, at den underliggende sikkerhed i værdipapirer med låneforpligtelser med sikkerhed (collateralised loan obligations, "CLO"), der ejes af porteføljen, har en NB-vurdering (som forklaret nedenfor). NB-vurderingen er opbygget omkring konceptet om finansielt væsentlige miljømæssige, sociale eller ledelsesmæssige risici, som overvejes for al den underliggende sikkerhed i CLO-værdipapirer.

Intet bæredygtigt investeringsmål	Denne portefølje fremmer miljømæssige og/eller sociale karakteristika, men har ikke bæredygtige investeringer som sit mål.
Miljømæssige eller sociale karakteristika, der fremmes af porteføljen	Følgende miljømæssige og sociale karakteristika fremmes af porteføljen på det underliggende sikkerhedsniveau i CLO-værdipapirerne: Miljømæssige karakteristika: Klima, drivhusgasemissioner og global forurening, påvirkning af landskaber, økosystemer og biodiversitet og Sociale karakteristika: Børnearbejde; korruption, bestikkelse, afpresning og hvidvaskning af penge; tvangsarbejde; krænkelse af menneskerettigheder og virksomheders medvirken; sundhed og sikkerhed på arbejdspladsen.
Investeringsstrategi	Porteføljen sigter mod opnå et gennemsnitligt målafkast på 4-5 % over benchmarket, ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (samlet afkast, USD), før fradrag af gebyrer i løbet af en markedscyklus (typisk 3 år eller mere) ved primært at investere i variabelt forrentede CLO-mezzanin-gældsbeviser denomineret i USD og EUR samt i amerikanske højtforrentede gældsbeviser, der er noteret eller handles på anerkendte markeder.
Andel af investeringerne	Porteføljen sigter mod direkte at holde mindst 60 % investeringer, der er i overensstemmelse med de miljømæssige eller sociale karakteristika, som porteføljen fremmer. Porteføljen forpligter sig ikke til at holde bæredygtige investeringer.
Overvågning af miljømæssige eller sociale karakteristika	Investeringsteamet overvejer en række bæredygtighedsindikatorer med henblik på at måle de miljømæssige og/eller sociale karakteristika, som porteføljen fremmer på det sikkerhedsniveau, der er underliggende i CLO-værdipapirerne, herunder: I. NB-vurderingen og II. Undgåelseskriterier og inddragelsespolitikker.
Metoder for miljømæssige eller sociale karakteristika	Investeringsteamet overvåger og aflægger rapport om udviklingen i forhold til de ovennævnte bæredygtighedsindikatorer. Disse bæredygtighedsindikatorer vil blive anvendt til at måle opnåelsen af hver af de miljømæssige og sociale karakteristika, der fremmes af porteføljen, og vil blive medtaget i porteføljens obligatoriske periodiske rapport.

Datakilder og databehandling	ESG-data- eller analyseinput indhentes fra proprietære investeringsværktøjer og intern research (som indarbejder kritisk tænkning og menneskelig dømmekraft i processen) samt flere datasæt, herunder internationale finansielle organisationer, eksterne dataleverandører, direkte oplysninger fra virksomheder, indirekte oplysninger fra virksomheder, udviklingsagenturer og specialiserede researchleverandører.
Begrænsninger mht. metoder og data	Begrænsninger mht. metoder og data kan omfatte, men er ikke begrænset til: manglende standardisering af dataleverandørers metoder, virksomheders ufuldstændige rapporteringsstandarder og uoverensstemmelse mellem virksomhedens ESG-data, som leveres af leverandører, uoverensstemmelser i leverandørernes metoder til at rapportere ESG-data og oplysninger om de underliggende data, der anvendes til at opnå tredjepartsparmetre, uoverensstemmelser i virksomheders hierarkier og identifikatorer for enheder kan føre til uoverensstemmelser i, hvordan dataleverandører tildeler og kortlægger ESG-datasæt til værdipapirer, lav dækning på tværs af visse indikatorer og aktivklasser for især private virksomheder og virksomheder, der har hjemsted i nye markeder (gæld og aktier), nogle datasæt indberettes muligvis med en væsentlig forsinkelse, og nogle af de tilgængelige tredjepartsdata beregnes ud fra dataestimer. Neuberger Berman er overbevist om, at for dets finansielle produkter, der er klassificeret som artikel 8 eller artikel 9 i henhold til SFDR, påvirker sådanne begrænsninger hverken fremmelsen af miljømæssige eller sociale karakteristika eller opnåelsen af det bæredygtige investeringsmål, som det relevante finansielle produkt har forpligtet sig til.
Due diligence	Inden der foretages investeringer, foretager Neuberger Berman rimelig og passende due diligence med grundlag i de kendsgerninger og omstændigheder, der er relevante for hver investering.
Politikker for aktivt ejerskab	Engagement er en vigtig del af porteføljens investeringsproces.
Angivet referencebenchmark	Ikke relevant

Senest opdateret: 1. juli 2025