

Nachhaltigkeit der Fondsanlage - Informationen nach Art. 9 und Art. 10 Transparenzverordnung

Fondsname:

Deka-Nachhaltigkeit Impact Aktien CF

ISIN:

LU2109588199

Fondsart:

Aktienfonds

Einstufung gemäß Transparenz-Verordnung:

ESG Impact-Fonds gemäß Art. 9

Verwaltungsgesellschaft:

Deka Investment GmbH

Erklärungen gem. Art. 9:

Im Investmentprozess dieses Fonds werden E (Environmental/Umwelt), S (social/sozial) und G (Governance/Unternehmens- und/oder Staatsführung) -Kriterien (ESG-Kriterien) mit besonderem Schwerpunkt betrachtet. Nachhaltigkeitsrisiken, welche sich aus der Analyse der ESG-Kriterien ergeben, werden mit Blick auf ihre finanzielle Wirkung kontinuierlich analysiert und die sich hieraus ergebenden Erkenntnisse zu den Nachhaltigkeitsrisiken einzelner Emittenten im Rahmen des Investmentprozesses bei der Bewertung der Ertrags- und Risikoeinschätzung berücksichtigt. Nachhaltigkeitsrisiken sind Ereignisse oder Bedingungen aus den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG), deren Eintreten tatsächlich oder potenziell wesentliche negative Auswirkungen auf den Wert der Investition des Fonds haben können. Nachhaltigkeitsrisiken können auf alle bekannten Risikoarten einwirken und als Faktor zur Wesentlichkeit dieser Risikoarten beitragen. Die Betroffenheit, Wahrscheinlichkeit und Schwere von Nachhaltigkeitsrisiken unterscheidet sich je nach Branche, Geschäftsmodell und Nachhaltigkeitsstrategie des Emittenten. Die Analyse der Nachhaltigkeitsrisiken erfolgt auf Basis von öffentlich verfügbaren Informationen der Emittenten (z.B. Geschäfts- und Nachhaltigkeitsberichte) oder einem internen Research sowie unter Verwendung von Daten und ESG-Ratings von Research- bzw. Ratingagenturen. Die Verwaltungsgesellschaft setzt ein Non-Financial-Risk- Komitee als Kontrollinstrument ein, welches kontinuierlich die Bewertung von Nachhaltigkeitsrisiken einzelner Emittenten überprüft und konkrete Vorgaben für das unter Nachhaltigkeitsrisiken investierbare Anlageuniversum gibt. Hierzu gehören neben Informationen auf Einzelemittentenebene ebenso Einschätzungen, welche auf Basis einer globalen Wirtschaftsanalyse getroffen werden (Einfluss von ESG-Kriterien auf das Wirtschaftswachstum oder die soziodemographischbedingte Nachfragesituation). Hierbei wird bis auf Branchenebene beleuchtet, wie ESG-Kriterien makroökonomische Trends bilden. Weiterhin erhalten die Mitarbeiter des Fondsmanagements regelmäßig umfassende Schulungen und Weiterbildungen zum Thema Nachhaltigkeit. Zudem wird ein betriebsinternes ESG-Risikostufenmodell genutzt, welches für die jeweiligen Emittenten eine ESG-Risikoeinstufung vornimmt und Emittenten, die eine gewisse Mindesteinstufung nicht überschreiten, aus dem Anlageuniversum ausschließt. Das Anlageuniversum dieses Fonds beschränkt sich auf Emittenten, die durch ihre Produktpalette und/oder durch Anpassung ihrer Produktionsprozesse sowie Dienstleistungen Lösungen zur Erreichung der „Ziele für nachhaltige Entwicklung“ der Vereinten Nationen (United Nations Sustainable Development Goals, SDGs) beitragen. Bei der Auswahl von Emittenten werden diejenigen ausgeschlossen, die den nachhaltigen Mindestkriterien des Fonds nicht entsprechen. Diese basieren zum Beispiel auf den Prinzipien des UN Global Compact. Darüber hinaus nimmt die Verwaltungsgesellschaft ihre Rolle als Investor aktiv wahr und setzt sich im Dialog mit den Emittenten für eine nachhaltige Unternehmensführung ein. Nachhaltigkeitsrisiken können sich im Investmentprozess negativ auf die Rendite dieses Fonds auswirken. Insbesondere können diese zu einer wesentlichen Verschlechterung der Finanzlage, der Rentabilität oder der Reputation der Emittenten führen und sich erheblich auf das Bewertungsniveau der Investition auswirken. Für das Fondsvermögen werden Anlagen getätigt, die zur Erreichung nachhaltiger, ökologischer, sozialer und/oder die verantwortungsvolle Unternehmensführung betreffende Ziele beitragen. Hierbei werden beispielweise die Aspekte Umwelt und Klimaschutz, Menschenrechte, Sicherheit und Gesundheit, Berichterstattung sowie Bekämpfung von Bestechung und Korruption beachtet. Es werden Unternehmen auf Basis betriebseigener Recherchen sowie unter Verwendung von Unternehmens- und spezifischen ESG-Daten von Research- bzw. Ratingagenturen analysiert und von Unternehmen für das Sondervermögen erworben, die durch ihre Produktpalette und/oder durch Anpassung ihrer Produktionsprozesse sowie Dienstleistungen Lösungen zur Erreichung der „Ziele für nachhaltige Entwicklung“ der Vereinten Nationen (United Nations Sustainable Development Goals, SDGs) darstellen. Bei diesem Fonds wird insbesondere ein aktiver Beitrag zur Erfüllung der Ziele „Gesundheit und Wohlergehen“ (SDG 3), „Bekämpfung von Wasserknappheit“ (SDG 6), „Bezahlbare und saubere Energie“ (SDG 7), „verantwortungsvoller Konsum und nachhaltige Produktion“ (SDG 12) sowie „Maßnahmen zum Klimaschutz“ (SDG 13) geleistet (sog. Impact Investing). Nicht investiert wird in Wertpapiere von Unternehmen, die geächtete Waffen produzieren und/oder gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstoßen. Die zehn Prinzipien des Global Compact umfassen Leitlinien zum Umgang mit Menschenrechten, Arbeitsrechten, Korruption und Umweltverstößen. Geächtete Waffen sind Waffen nach dem Übereinkommen über das Verbot des Einsatzes, der Lagerung, der Herstellung und der Weitergabe von Antipersonenminen und über deren Vernichtung („Ottawa-Konvention“), dem Übereinkommen über das Verbot von Streumunition („Oslo-Konvention“) sowie B- und C-Waffen nach den jeweiligen UN-Konventionen (UN BWC und UN CWC). Zusätzlich werden diejenigen Unternehmen und Staaten mit einer ESG-Bewertung von weniger als B von MSCI ESG Research LLC oder einer vergleichbaren ESG-Bewertung von einem anderen Anbieter ausgeschlossen. Zudem wird dem Ziel der Verwirklichung der langfristigen Erderwärmungsziele des Übereinkommens von Paris (Paris Agreement vom 15.12.2015) Rechnung getragen. Dies erfolgt durch gezielte Anlagen in Unternehmen, welche entweder durch ihre Produktpalette und/oder durch ihre Produktionsprozesse zu diesem Ziel beitragen. Die Verwaltungsgesellschaft legt zudem bei Investitionsentscheidungen die Prinzipien für verantwortliches Investieren (PRI) zugrunde.

Warnhinweis:

Die Wertentwicklung des Fonds kann durch Nachhaltigkeitsrisiken beeinflusst werden. Nachhaltigkeitsrisiken im Sinne der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor sind Ereignisse oder Bedingungen aus den Bereichen Umwelt, Soziales oder Unternehmensführung, deren Eintreten tatsächlich oder potenziell wesentliche negative Auswirkungen auf den Wert der Investition des Fonds haben könnten. Nachhaltigkeitsrisiken können auf alle bekannten Risikoarten einwirken und als Faktor zur Wesentlichkeit dieser Risikoarten beitragen. Beispielhaft sind die in den nachfolgenden Abschnitten beschriebenen Risikoarten Marktrisiko, Liquiditätsrisiko, Kontrahentenrisiko und operationelles Risiko zu nennen.

Erklärungen gem. Art. 10:

Das Ziel des Fonds ist es, durch die Nutzung von Chancen und die Vermeidung von Risiken, die sich aus ökonomischen, ökologischen und sozialen Entwicklungen ergeben, ein mittel- bis langfristiges Kapitalwachstum zu erwirtschaften. Mindestens 61% des Fondsvermögens werden in Aktien investiert.

Für das Fondsvermögen werden Anlagen getätigt, die zur Erreichung nachhaltiger ökologischer, sozialer und/oder die verantwortungsvolle Unternehmensführung betreffende Ziele beitragen. Hierbei werden beispielsweise die Aspekte Umwelt- und Klimaschutz, Menschenrechte, Sicherheit und Gesundheit, Berichterstattung sowie Bekämpfung von Bestechung und Korruption beachtet.

Für die Bewertung der von dem Finanzprodukt ausgewählten nachhaltigen Investitionen werden verschiedene Methoden angewendet:

Es werden Unternehmen auf Basis betriebseigener Recherchen sowie unter Verwendung von Unternehmens- und spezifischen ESG-Daten von Research- bzw. Ratingagenturen analysiert und von Unternehmen für das Sondervermögen erworben, die durch ihre Produktpalette und/oder durch Anpassung ihrer Produktionsprozesse sowie Dienstleistungen Lösungen zur Erreichung der „Ziele für nachhaltige Entwicklung“ der Vereinten Nationen (United Nations Sustainable Development Goals, SDGs) darstellen. Bei diesem Fonds wird ein aktiver Beitrag (unter anderem und) insbesondere zur Erfüllung der Ziele „Gesundheit und Wohlergehen“ (SDG 3), „Bekämpfung von Wasserknappheit“ (SDG 6), „Bezahlbare und saubere Energie“ (SDG 7), „verantwortungsvoller Konsum und nachhaltige Produktion“ (SDG 12) sowie „Maßnahmen zum Klimaschutz“ (SDG 13) geleistet (Impact Investing).

Nicht investiert wird in Wertpapiere von Unternehmen, die geächtete Waffen produzieren und/oder gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstoßen. Die zehn Prinzipien des Global Compact umfassen Leitlinien zum Umgang mit Menschenrechten, Arbeitsrechten, Korruption und Umweltverstößen.

Geächtete Waffen sind Waffen nach dem Übereinkommen über das Verbot des Einsatzes, der Lagerung, der Herstellung und der Weitergabe von Antipersonenminen und über deren Vernichtung („Ottawa-Konvention“), dem Übereinkommen über das Verbot von Streumunition („Oslo-Konvention“) sowie B- und C-Waffen nach den jeweiligen UN-Konventionen (UN BWC und UN CWC).

Zusätzlich werden diejenigen Unternehmen und Staaten mit einer ESG-Bewertung von weniger als B von MSCI ESG Research LLC oder einer vergleichbaren ESG-Bewertung von einem anderen Anbieter ausgeschlossen.

Zudem wird dem Ziel der Verwirklichung der langfristigen Erderwärmungsziele des Übereinkommens von Paris (Paris Agreement vom 15.12.2015) Rechnung getragen. Dies erfolgt durch gezielte Anlagen in Unternehmen, welche entweder durch ihre Produktpalette und/oder durch ihre Produktionsprozesse zu diesem Ziel beitragen.

Die Überwachung der Konformität der Investitionsentscheidungen mit den festgelegten Kriterien erfolgt im Rahmen von standardisierten Prozessen. Es können nur Investitionsentscheidungen getroffen und entsprechende Kauf- oder Verkaufstransaktionen durchgeführt werden, welche im Rahmen der Vorabprüfung den definierten Kriterien entsprechen. Eine Transaktion kann nicht ausgeführt werden, wenn sie gegen die festgelegten ESG-Kriterien verstößt. Sollten für einen Emittenten keine Daten oder ESG-Ratings von Research- bzw. Ratingagenturen vorliegen noch betriebseigene Recherchen möglich sein, wird in Wertpapiere dieses Emittenten nicht investiert.

Die Verwaltungsgesellschaft beachtet zudem die Prinzipien für verantwortliches Investieren (PRI).

Für die Messung der Reduktion der CO₂-Emissionen des Portfolios wird die „CO₂-Intensität“ als Nachhaltigkeitsindikator der Investitionen genutzt. Hierfür wird die Kennzahl durchschnittliche gewichtete CO₂-Intensität herangezogen. Zudem wird auch die „ökologische Wirkung“ und „soziale Wirkung“ dargestellt. Die ökologische Wirkung einer Investition in den Fonds ergibt sich aus der Summe der Gesamtumsätze der investierten Unternehmen in den Bereichen „Klimawandel“ (z.B. alternative Energien oder Energieeffizienz) und „natürliche Ressourcen“ (z.B. nachhaltige Wasserwirtschaft oder Umweltschutz). Bei der sozialen Wirkung wird die Summe der Gesamtumsätze der investierten Unternehmen in den Bereichen „Erfüllung von Grundbedürfnissen“ (z.B. Gesundheit und Wohlergehen oder sauberes Wasser) und „Förderung“ (z.B. Finanzierung von Klein- und mittleren Unternehmen oder hochwertige Bildung) herangezogen. Diese basieren auf veröffentlichten und/oder gegebenenfalls geschätzten Daten, welche von den Unternehmen selbst oder Research- bzw. Ratingagenturen bereitgestellt werden.

Anmerkungen: Die Informationen werden vom Fondsanbieter erstellt. Sollten Sie hierzu Fragen haben, verweisen wir Sie gern an dessen Webseite.

Stand:

03.2021