

# Helaba Invest

## HI-Sustainable Multi-Faktor Aktien Global-Fonds

Offenlegung von Produktinformationen für Finanzprodukte, mit denen ökologische oder soziale Merkmale angestrebt werden (Art. 8), auf der Internetseite gem. Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor

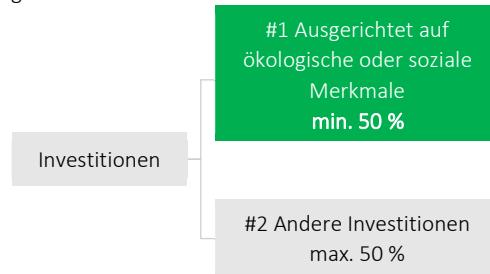
(Stand: 24.11.2023)

<b>I. Zusammenfassung</b>
<p>Der HI-Sustainable Multi-Faktor Aktien Global-Fonds investiert im Rahmen einer nachhaltigen Multi-Faktor-Strategie in globale Aktien aus entwickelten Märkten und strebt eine deutliche Verbesserung der Nachhaltigkeitskennzahlen gegenüber dem Referenzindex (MSCI World) an. Der Fonds berücksichtigt die hauseigene ESG-Investment-Policy sowie darüberhinausgehende Ausschlüsse aus den Bereichen kontroverse Waffen, Rüstungsgüter, zivile Waffen, Kohle und Tabak. Ferner investiert der Fonds nicht in Emittenten mit Verstößen gegen die Prinzipien des UN Global Compact. Des Weiteren zielt die Anlagestrategie auf die Reduktion von ausgewählten unternehmensspezifischen Risiken ab, die sich aus dem Transformationsprozess hin zu einer nachhaltigen Wirtschaft ergeben.</p> <p>Die zugrunde liegenden Daten werden vom Datenanbieter MSCI ESG Research bezogen.</p>
<b>II. Kein nachhaltiges Investitionsziel</b>
<p>Mit diesem Finanzprodukt werden ökologische oder soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen angestrebt.</p>
<b>III. Ökologische oder soziale Merkmale des Finanzprodukts</b>
<p>Der HI-Sustainable Multi-Faktor Aktien Global-Fonds investiert im Rahmen einer nachhaltigen Multi-Faktor-Strategie in globale Aktien aus entwickelten Märkten. Die auf der Helaba Invest ESG-Investment-Policy aufbauende, und in Teilen darüberhinausgehende, Nachhaltigkeitsstrategie des Fonds verfolgt nicht ein einzelnes ökologisches (E) oder soziales (S) Ziel oder Ziele in der Unternehmensführung (G), sondern beachtet bei der Anlage Mindestanforderungen in allen drei Bereichen.</p>
<b>IV. Anlagestrategie</b>
<p>Die Nachhaltigkeitsstrategie des Fonds berücksichtigt die Vorgaben der hauseigenen ESG-Investment-Policy und geht zudem in einigen Bereichen seiner ESG-Strategie darüber hinaus. Die ESG-Investment-Policy stellt eine verbindliche Grundlage für Nachhaltigkeitsaspekte in Form von ethischen Standards, Risikomanagement und klimabezogenen Themen für alle im Portfoliomanagement der Helaba Invest verankerten Investmentprozesse dar. Um einen aktiven Beitrag zur Erreichung einer nachhaltigeren Kapitalanlage und insbesondere der Klimaziele zu leisten, verzichten wir auf Basis von Umsatzgrenzen auf Investitionen in Unternehmen, deren Geschäftsmodell stark auf die Kohleverstromung sowie den Abbau und Vertrieb thermischer Kohle ausgelegt ist (Umsatzanteil &gt; 10%).</p> <p>Darüber hinaus ist eine Investition in Unternehmen ausgeschlossen, die den Abbau von Öl- und Teersanden, Fracking und Arctic Drilling betreiben und dabei einen Umsatzanteil größer 5% aus diesen Bereichen generieren. Durch die Anwendung der oben genannten Mindestausschlüssen und die gleichzeitige Berücksichtigung von besonders nachhaltigen Titeln für das Portfolio sollen der CO<sub>2</sub>-Fußabdruck, die Treibhausgasemissionen inkl. -intensität sowie das Exposure zu fossilen Brennstoffen und konventioneller Energiegewinnung deutlich gegenüber dem Referenzindex (MSCI World) verbessert werden. Zudem wird über eine bessere Ratingverteilung und ein höheres Ratingmomentum eine deutliche Steigerung des ESG Quality Scores im Vergleich zu dem Referenzindex (MSCI World) angestrebt.</p> <p>Des Weiteren zielt die Anlagestrategie auf die Reduktion von unternehmensspezifischen Risiken ab, die sich aus dem Transformationsprozess hin zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft ergeben. Gleichzeitig werden Anbieter von klimafreundlichen Lösungen übergewichtet. Hersteller kontroverser Waffen inkl. Nuklearwaffen gelten vor dem Hintergrund einer Null-Toleranz-Strategie gegenüber ethischen Verfehlungen, uneingeschränkt als nicht investierbar. Ferner investiert der Fonds nicht in Emittenten mit Verstößen gegen die Prinzipien des UN Global Compact. Davon sind Unternehmen betroffen, deren Geschäftstätigkeiten u.a. nicht in Einklang mit den Prinzipien der Kategorien „Menschenrechte“, „Arbeitsnormen“, „Umweltschutz“ und „Korruptionsprävention“ stehen.</p> <p>Wir beachten zudem bei Investitionsentscheidungen die Prinzipien für verantwortliches Investieren der Vereinten Nationen (UN PRI).</p> <p>Zur Förderung einer guten Unternehmensführung wird nicht in Unternehmen mit sehr schweren ESG-Kontroversen (wie Verstößen gegen den UN Global Compact) und Unternehmen mit sehr schwachen ESG-Ratings (CCC) investiert.</p>

# Helaba Invest

## V. Aufteilung der Investitionen

Zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale werden mindestens 50 % der Investition auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet. Gemessen werden die E/S-Merkmale anhand eines ESG-Ratings. Nachhaltige Investitionen werden nicht angestrebt.



## VI. Überwachung der ökologischen oder sozialen Merkmale

Die Einhaltung der definierten Nachhaltigkeitskriterien wird von unserem Controlling im Rahmen der Grenzprüfung technisch implementiert und mit Hilfe der Grenzprüfung überwacht. Es können nur Investitionsentscheidungen getroffen werden, welche im Rahmen der Vorabprüfung den definierten ökologischen oder sozialen Merkmalen entsprechen. Eine Transaktion kann nicht ausgeführt werden, wenn sie gegen die festgelegten ökologischen oder sozialen Merkmale verstößt. Die Analyse der Nachhaltigkeitsdaten erfolgt kontinuierlich. Auffällige Emittenten stehen besonders im Fokus und werden regelmäßig beurteilt.

## VII. Methoden für ökologische oder soziale Merkmale

Die Entscheidung für ein Investment in einen speziellen Einzeltitel wird im Zusammenhang mit dem Thema Nachhaltigkeit auf Basis folgender Parameter und zugehöriger Umsatzgrenzen getroffen (Mindestausschlüsse):

- Kohleverstromung > 10%
- Abbau/Vertrieb thermischer Kohle > 10%
- Ölsande/Teersande > 5%
- Arctic Drilling/Fracking > 5%
- Clusterbomben > 0%
- Landminen > 0%
- Bio-/Chemie-Waffen > 0%
- Nuklearwaffen > 0%
- Waffen mit abgereichertem Uran > 0%
- Waffen mit Non-Detectable Fragments > 0%
- Blendlaser Waffen > 0%
- Waffen mit weißem Phosphor > 0%
- Rüstungsgüter > 10%
- Produzenten ziviler Waffen > 0%
- Zivile Waffen Umsatzanteile > 5%
- Tabakproduzenten > 0%
- Tabak Vertrieb/Großhandel > 5%
- Tabak Umsatzanteile > 5%
- ESG-Ratings < B
- Keine Derivate, deren Basiswerte Nahrungsmittel sind
- Sehr schwere ESG-Kontroversen
- Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact (ohne positive Perspektive) – die Prinzipien sind:
  - Schutz der internationalen Menschenrechte
  - Keine Mitschuld an Menschenrechtsverletzungen
  - Wahrung der Vereinigungsfreiheit und des Rechts auf Kollektivverhandlungen
  - Beseitigung von Zwangsarbeit
  - Abschaffung der Kinderarbeit
  - Beseitigung von Diskriminierung bei Anstellung und Erwerbstätigkeit
  - Vorsorgeprinzip im Umgang mit Umweltproblemen
  - Förderung größeren Umweltbewusstseins
  - Entwicklung und Verbreitung umweltfreundlicher Technologien

# Helaba Invest

o Eintreten gegen alle Arten von Korruption
<b>VIII. Datenquellen und -verarbeitung</b>
Die den Ausschlüssen zugrunde liegenden Daten werden vom Datenanbieter MSCI ESG Research bezogen.
<b>IX. Beschränkungen hinsichtlich der Methoden und Daten</b>
Die Berücksichtigung von ESG-Kriterien erfolgt insoweit, wie die maßgeblichen Daten, die zur Feststellung und Gewichtung der nachteiligen Nachhaltigkeitsauswirkungen herangezogen werden müssen, entsprechend vorliegen. Derzeit sind nicht für alle Vermögensgegenstände, in die die Gesellschaft über die verwalteten Fonds und Mandate investiert, die benötigten Daten in ausreichendem Umfang und/oder in der erforderlichen Qualität vorhanden. Zur Verbesserung der Datenqualität befinden wir uns in einem stetigen Austausch mit externen ESG-Datenanbietern und entwickeln unsere internen Prozesse kontinuierlich weiter.
<b>X. Sorgfaltspflicht</b>
Die Geschäftsführung verantwortet die Integration von Nachhaltigkeitskriterien in den jeweiligen Investmentprozessen, deren detaillierte Ausgestaltung in Zusammenarbeit mit den zuständigen Führungskräften und Nachhaltigkeitsexperten erfolgt. Die Umsetzung in den Portfolios erfolgt durch die zuständigen Portfoliomanagerinnen und Portfoliomanager. Die Abteilung Risk & Reporting stellt als organisatorisch unabhängige Einheit sicher, dass die verfolgte Nachhaltigkeitsstrategie eingehalten wird. In den Geschäftsbereichen „Liquide“ und „Illiquide“ nehmen die jeweiligen ESG-Komitees zentrale Aufgaben wahr, um insbesondere Nachhaltigkeitsrisiken im Rahmen des Investmentprozesses bzw. des Monitorings der Bestandsinvestments (für illiquide Investments) zu berücksichtigen. Details sind der veröffentlichten ESG-Investment-Policy der Helaba Invest zu entnehmen.
<b>XI. Mitwirkungspolitik</b>
Als Kapitalanlagegesellschaft vertreten wir die Interessen und Stimmrechte unserer Anleger gegenüber Aktiengesellschaften. Bei der Stimmrechtsausübung handeln wir ausschließlich im Interesse der Anleger des jeweiligen Investmentvermögens. Nähere Informationen zu unserer Stimmrechtsausübung finden Sie auf unserer Website im Dokument „Leitlinien für das Abstimmungsverhalten auf Hauptversammlungen von Aktiengesellschaften“.
<b>XII. Bestimmter Referenzwert</b>
Der HI-Sustainable Multi-Faktor Aktien Global-Fonds hat als Referenzwert den MSCI World Index festgelegt, um die Erfüllung der von ihm geförderten ökologischen oder sozialen Merkmale in Form eines reduzierten CO2-Fußabdrucks und eines verbesserten ESG Quality Scores zu messen. Aufgrund der Qualifizierung des MSCI World als breiter Marktindex werden die ökologischen und sozialen Merkmale allein durch die Anlagestrategie des Fonds umgesetzt. Beim MSCI World handelt es sich um einen breiten Marktindex, der keine expliziten ESG-Ziele verfolgt.