

# MÖGLICHE AUSWIRKUNGEN

## der Nachhaltigkeitsrisiken auf die Rendite der Fonds/Teilfonds der DJE Investment S.A.



Stand: 01/2023

1 | 2

### Nachhaltigkeitsrisiken

Als Nachhaltigkeitsrisiko gilt ein Ereignis oder eine Bedingung in den Bereichen Umwelt, Soziales oder Unternehmensführung, dessen beziehungsweise deren Eintreten tatsächlich oder potenziell wesentliche negative Auswirkungen auf den Wert der Investition des jeweiligen Teilfonds haben könnte. Diese Effekte können sich auf die Vermögens-, Finanz- und Ertragslage des jeweiligen Teilfonds sowie auf die Reputation der Gesellschaft auswirken. Nachhaltigkeitsrisiken können auf alle bekannten Risikoarten (Marktrisiko, Liquiditätsrisiko, Kontrahentenrisiko und operationelles Risiko) erheblich einwirken und als Faktor zur Wesentlichkeit dieser Risikoarten beitragen. Unternehmen, in die der jeweilige Teilfonds investiert, können physischen Risiken des Klimawandels unterliegen wie z. B. Temperaturschwankungen, Anstieg des Meeresspiegels etc.

Nachhaltigkeitsrisiken können sich je nach Art des Risikos mehr oder weniger stark negativ auf die Rendite der Investition des Fonds auswirken. Negative Auslöser können sein:

- Physische Schäden aufgrund von extremen Wittereinflüssen
- Unverhältnismäßig hohe Investitionsaufwendungen
- Strafzahlung aufgrund Missachtung geltender Gesetze
- Reputationsschäden aufgrund Missachtung von Klima-, Umweltschutz oder sozialen Werten & Normen

Ein negativer Einfluss durch Nachhaltigkeitsrisiken auf die Rendite der Investition des Fonds kann jedoch nicht ganz ausgeschlossen werden.

Das jeweilige (teil-)fondsspezifische Nachhaltigkeitsrisiko wird anhand des nachfolgenden Verfahrens der Verwaltungsgesellschaft gemessen:

Anhand der ESG-Ratings sowie der jeweiligen Gewichtung der im jeweiligen Teilfonds befindlichen Wertpapiere kann ein ESG-Rating auf (Teil)-Fondsebene aggregiert werden. Bankguthaben und Derivate sind hiervon ausgenommen.

Als Datenanbieter wird hierbei MSCI ESG Research LLC. verwendet. Das ESG-Rating gibt an, wie gut ein Emittent seine relevantesten ESG-Risiken im Vergleich zu einer Peer-Group verwaltet. Emittenten mit einem geringen Risiko und einem guten Management erhalten dabei ein höheres Rating im Vergleich zu Emittenten, die stärkeren Risiken ausgesetzt sind bzw. die über ein schwächeres Management der Risiken verfügen.

Anhand des aggregiertes ESG-Ratings erfolgt die nachfolgende Zuordnung der ESG-Risikoklasse:

ESG-Risikoklasse	ESG-Risiko	Aggregiertes ESG-Rating
ESG-Risikoklasse 1	Niedriges ESG-Risiko	AAA
ESG-Risikoklasse 2		AA
ESG-Risikoklasse 3	Mittleres ESG-Risiko	A
ESG-Risikoklasse 4		BBB
ESG-Risikoklasse 5	Hohes ESG-Risiko	BB B CCC

(Auszug aus den Verkaufsprospekten der nachfolgend genannten Fonds/ Teilfonds)

Weitere Informationen können auf der Internetseite [www.dje.lu](http://www.dje.lu) oder bei der Verwaltungsgesellschaft angefragt werden.

Einstufung der DJE Investment S.A Fonds gemäß der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor

# MÖGLICHE AUSWIRKUNGEN

der Nachhaltigkeitsrisiken auf die Rendite der  
Fonds/Teilfonds der DJE Investment S.A.

ISIN	Fondsname	Tranche	Fondskategorisierung	Einstufung gem. Verordnung (EU) 2019/2088 des Europ. Parl. der Offenlegungspflichten
LU0350835707	DJE – Agrar & Ernährung	PA (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0350836184	DJE – Agrar & Ernährung	I (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0350836341	DJE – Agrar & Ernährung	XP (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0159549145	DJE – Multi Asset & Trends	PA (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0159550747	DJE – Multi Asset & Trends	I (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU1714355366	DJE – Multi Asset & Trends	XP (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0374456654	DJE – Asien	PA (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0374456811	DJE – Asien	I (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0374457033	DJE – Asien	XP (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0858224032	DJE – Concept	PA (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0124662932	DJE – Concept	I (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU1714355283	DJE – Concept	XP (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0828771344	DJE – Dividende & Substanz	PA (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0159550150	DJE – Dividende & Substanz	P (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0159551042	DJE – Dividende & Substanz	I (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0229080733	DJE – Dividende & Substanz	XP (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0383655254	DJE – Dividende & Substanz	I (H-CHF)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0159548683	DJE – Europa	PA (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0159550408	DJE – Europa	I (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0229080576	DJE – Europa	XP (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0159550077	DJE – Gold & Ressourcen	PA (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0159550820	DJE – Gold & Ressourcen	I (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0383654950	DJE – Gold & Ressourcen	XP (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU1227570055	DJE – Mittelstand & Innovation	PA (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU1227570485	DJE – Mittelstand & Innovation	I (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU1227571020	DJE – Mittelstand & Innovation	XP (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0159549574	DJE – Renten Global	PA (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0159550580	DJE – Renten Global	I (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0229080659	DJE – Renten Global	XP (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0159549814	DJE – Short Term Bond	PA (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0159551125	DJE – Short Term Bond	I (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU1714355440	DJE – Short Term Bond	XP (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU2262057305	DJE – Umwelt & Werte	XP (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0553164731	DJE – Zins & Dividende	PA (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0553169458	DJE – Zins & Dividende	I (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0553171439	DJE – Zins & Dividende	XP (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU1794438561	DJE – Zins & Dividende	XT (EUR)	OGAW	Art. 8 OVO
LU0323357649	DJE Gold & Stabilitätsfonds	PA	AIF	Art. 8 OVO
LU0344733745	DJE Gold & Stabilitätsfonds	IA	AIF	Art. 8 OVO