

MÖGLICHE AUSWIRKUNGEN

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



Stand: 01/2023

1 | 2

Nachhaltigkeitsrisiken

Für die Berücksichtigung von Nachhaltigkeitsrisiken bei den Investitionsentscheidungen berücksichtigt der Fondsmanager die Berichterstattung von Emittenten. Dabei kann sich der Fondsmanager auch der Auswertung Dritter (z.B. Datenanbieter, Ratingprovider etc.) bei den jeweiligen Emittenten bzw. Anbietern bedienen, die auch in aggregierter Form z.B. durch ein Rating eine Auswertung zur Verfügung stellen. Sogenannte ESG-Ratings können genutzt werden, um das Risiko von Nachhaltigkeitsrisiken zu messen. Ein positives ESG-Rating kann im Vergleich zu einem niedrigen ESG-Rating ein Indiz für ein geringeres Nachhaltigkeitsrisiko sein, es kann jedoch nicht vollständig ausgeschlossen werden. Nachhaltigkeitsrisiken werden entsprechend den Anlagezielen und der Anlagepolitik des jeweiligen Teilfonds in die Investitionsentscheidungen des Fondsmanagers einbezogen.

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

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

Gegenwärtig liegen keine wissenschaftlich gesicherten Erkenntnisse für die zu erwartenden Auswirkungen von Nachhaltigkeitsrisiken auf die Rendite des jeweiligen Teilfonds vor.

Tendenziell ist zu erwarten, dass sich Nachhaltigkeitsrisiken möglicherweise negativ auf die Rendite der Investition des jeweiligen Teilfonds auswirken können und somit kann ein negativer Einfluss durch Nachhaltigkeitsrisiken nicht ganz ausgeschlossen werden. (Auszug aus dem Verkaufsprospekt RB LuxTopic)

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

Weitere Informationen können auf der Internetseite 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

ISIN	Fondsname	Tranche	Fondskategorisierung	Einstufung gem. Verordnung (EU) 2019/2088 des Europ. Parl. der Offenlegungspflichten
LU0592234537	RB LuxTopic - Aktien Europa	B	OGAW	Art. 8 OVO
LU0165251116	RB LuxTopic - Aktien Europa	A	OGAW	Art. 8 OVO
LU0191701282	RB LuxTopic - Flex	A	OGAW	Art. 8 OVO
LU2185964876	RB LuxTopic - Flex	B	OGAW	Art. 8 OVO
LU1181278976	RB LuxTopic - Systematic Return	A	OGAW	Art. 8 OVO
LU1181280105	RB LuxTopic - Systematic Return	B	OGAW	Art. 8 OVO