

Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungen nach Art. 10 der Offenlegungs-Verordnung Zusammenfassung

1. Kein nachhaltiges Investitionsziel

Mit dem Finanzprodukt DJE Managed Depots werden ökologische oder soziale Merkmale beworben, aber keine Mindestquote in nachhaltigen Investitionen im Sinne von Art. 2 Ziff. 17 der Offenlegungs-Verordnung angestrebt. Es kann jedoch sein, dass einige der Investitionen im Rahmen des DJE Managed Depots nachhaltige Investitionen im Sinne von Art. 2 Ziff. 17 der Offenlegungs-Verordnung darstellen, obwohl dies nicht im Investmentprozess der DJE Managed Depots angestrebt wird.

DJE verfolgt bei den Investitionen in Einzeltitel im Rahmen der eingesetzten DJE-Fonds einen Best-in-class-Ansatz unter Berücksichtigung von Ausschlüssen von Unternehmen, die gegen gewisse Prinzipien verstoßen, um mögliche negative Auswirkungen auf die Umwelt und Soziales zu reduzieren. Bei den in den DJE Managed Depots eingesetzten Zielfonds, achtet DJE darauf, dass überwiegend Fonds eingesetzt werden, die nach Art. 8 oder Art. 9 der Offenlegungs-Verordnung eingestuft sind und die selbst die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen berücksichtigen.

Werden für dieses Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (sogenannte „principle adverse impacts“ („PAIs“)) von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

- Ja
 Nein

2. Ökologische oder soziale Merkmale des Finanzprodukts

- Ausschlusskriterien ESG-Integration
 Nachhaltige Investitionen [andere]

3. Anlagestrategie

Allgemein erfolgt die Zusammenstellung des Portfolios, abgesehen von nachfolgend genannten Bedingungen, aktiv und unabhängig von jeglichen Vergleichsindex-, Sektor-, Länder-, Laufzeit-, Marktkapitalisierungs- und Ratingvorgaben unter Berücksichtigung von ESG-Faktoren und nachteiligen Nachhaltigkeitsauswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren. DJE berücksichtigt bei dem Finanzprodukt DJE Managed Depots unter anderem ökologische und/oder soziale Merkmale, indem sie überwiegend in Fonds investiert, die ebenfalls ökologische und/oder soziale Merkmale berücksichtigen sowie bei ihren Investitionen die Einhaltung von Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung bewerten. Hierbei werden auch verschiedene Ausschlusskriterien von DJE berücksichtigt. Im Rahmen dieser Investmentausschlüsse werden Fonds vom Erwerb ausgeschlossen, die Investitionen zu mehr als 0,49% in entsprechende Emittenten enthalten (Ausnahme kontroverse/geächtete Waffen: 0%). Die Quote bezieht sich auf das einzelne Ausschlusskriterium.

Zusätzlich müssen mindestens 51% der Zielinvestments auf Gesamtportfolioebene als Art. 8 oder Art. 9 Fonds gemäß der Offenlegungs-Verordnung einklassifiziert sein. Bei diesen 51% der Zielinvestments werden zusätzlich die PAI indirekt berücksichtigt, indem geprüft wird, ob der jeweilige Zielfonds seinerseits die PAI bei seinen Investitionen berücksichtigt. Nur wenn dies der Fall ist, kann der jeweilige Zielfonds in die 51%-Quote eingerechnet werden. Zudem müssen alle erwerbzbaren Zielfonds über ein ESG-Rating durch MSCI ESG Research LLC. von mindestens BB oder besser verfügen.

4. Aufteilung der Investitionen

Die vorgegebenen Ausschlusskriterien werden für alle Investitionen in Fonds angewendet.

Zudem müssen mindestens 51% des Gesamtportfolios auf ökologische und/oder soziale Merkmale ausgerichtet sein. Höchstens 49% des Gesamtportfolios dürfen andere Investitionen darstellen.

5. Überwachung der ökologischen oder sozialen Merkmale

Die Einhaltung der unter „Anlagestrategie“ und „Ökologische oder soziale Merkmale des Finanzprodukts“ aufgeführten Ausschlüsse sowie die Toleranzgrenze wird im Pre-Trade- und Post-Trade-Verfahren mittels MSCI ESG Research LLC geprüft.

Das jeweils aktuelle Portfolio des Finanzprodukts DJE Managed Depots wird regelmäßig anhand der Daten auf mögliche passive Anlageverstöße aufgrund von Datenveränderungen überprüft.

- Ausschlusskriterien ESG-Integration
 Nachhaltige Investitionen [andere]

6. Methoden für ökologische oder soziale Merkmale

Es werden die unter „Anlagestrategie“ und „Beschreibung der ökologischen oder sozialen Merkmale“ aufgeführten Ausschlüsse berücksichtigt.

Ausschlusskriterien Definierte Ausschlusskriterien werden mit Hilfe von externen Datenfeldern für alle Investitionen des Portfolios geprüft.

ESG-Integration DJE berücksichtigt bei dem Finanzprodukt DJE Managed Depots unter anderem ökologische und/oder soziale Merkmale, indem sie überwiegend in Fonds investiert, die ebenfalls ökologische und/oder soziale Merkmale berücksichtigen sowie bei ihren Investitionen die Einhaltung von Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung bewerten. Hierbei werden auch verschiedene Ausschlusskriterien von DJE berücksichtigt.

Nachhaltige Investitionen

7. Datenquellen und -verarbeitung

Als Hauptdatenlieferung fungiert MSCI ESG Research LLC.

DJE kann die vorhandenen Daten im Zweifelsfall einer Überprüfung unterziehen. DJE kann bei der Überprüfung zum Ergebnis gelangen, dass die Daten die tatsächliche Situation nicht angemessen berücksichtigen und diese insofern berichtigen, dass ein adäquateres Abbild der Realität geschaffen wird.

8. Beschränkungen hinsichtlich der Methoden und Daten

Die Methoden und Daten sind dahingehend eingeschränkt, dass nicht zu allen eingesetzten Fonds Daten vorhanden bzw. geliefert werden können. Zudem können Daten für einen einzelnen Emittenten nicht in einem ausreichenden Umfang vorhanden sein. Ferner können diese Daten auf Schätzungen beruhen. Fonds ohne Daten fallen in den Bereich von „anderen Investitionen“.

9. Sorgfaltspflicht

DJE hat zur Wahrung der Sorgfaltspflicht in Zusammenhang mit den im DJE Managed Depots enthaltenen Portfolio diverse Kontrollen implementiert: Die Fondsauswahl unterliegt diversen Vorgaben und Ausschlusskriterien, die regelmäßig laufend überwacht werden.

10. Mitwirkungspolitik

DJE berichtet jährlich über die Umsetzung der Mitwirkungspolitik. Die Mitwirkungspolitik sowie der Mitwirkungsbericht werden öffentlich unter www.dje.de unter der Rubrik „Rechtliche Hinweise“ zugänglich gemacht und zumindest jährlich aktualisiert.

11. Bestimmter Referenzwert

Für das Finanzprodukt DJE Managed Depots wurde kein Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist.