

Hinweis

Dieses Dokument stellt einen Auszug aus dem Verkaufsprospekt dar und sollte im Zusammenhang mit diesem gelesen werden. Sofern die Sprachfassungen des Verkaufsprospekts und dieses Dokuments an irgendeiner Stelle voneinander abweichen, ist die Fassung des Verkaufsprospekts/Jahresberichts maßgeblich.

Allein verbindliche Grundlage für den Erwerb von Fondsanteilen sind das Basisinformationsblatt, der Verkaufsprospekt sowie der letzte Jahres- bzw. Halbjahresbericht des Investmentfonds.

Stand: 5. Oktober 2023

Anhang 2B

DJE – Multi Asset & Trends

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomie-konform sein oder nicht.

Name des Produkts: DJE – Multi Asset & Trends

Unternehmenskennung (LEI-Code): 529900DTV155RX08WD08

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wird damit ein **Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ____%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als **ökologisch nachhaltig** einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie **nicht als ökologisch nachhaltig** einzustufen sind

Es wird damit ein **Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ____%

Es werden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt werden, enthält es einen **Mindestanteil von 15 % an nachhaltigen Investitionen**

mit einem **Umweltziel** in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als **ökologisch nachhaltig** einzustufen sind

mit einem **Umweltziel** in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie **nicht als ökologisch nachhaltig** einzustufen sind

mit einem **sozialen Ziel**

Es werden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**



Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?

Mit dem Finanzprodukt werden die nachfolgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale beworben:

- Berücksichtigung von Ausschlusskriterien aus den Bereichen Umwelt und Soziales sowie Unternehmensführung
- Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen des Teilfonds auf Nachhaltigkeitsfaktoren
- Mindestquote von 65% des Teilfondsvermögens in Wertpapieren mit einem ESG-Rating MSCI ESG Research LLC von mindestens BB
- Mindestquote von 15% des Teilfondsvermögens in nachhaltigen Investitionen im Sinne von Art. 2 Ziff. 17 der Offenlegungs-Verordnung

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● Welche Nachhaltigkeitsindikatoren werden zur Messung der Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale, die durch dieses Finanzprodukt beworben werden, herangezogen?

Der Fondsmanager verfolgt einen Best-in-class-Ansatz unter Berücksichtigung der nachfolgenden Ausschlüsse.

Der Teilfonds strebt eine Mindestquote von 15% des Teilfondsvermögens in nachhaltigen Investitionen im Sinne von Art. 2 Ziff. 17 der Offenlegungs-Verordnung an.

Mindestens 65% des Teilfondsvermögens muss in Wertpapieren angelegt sein für die ein ESG-Rating MSCI ESG Research LLC von mindestens BB vorhanden ist.

Es werden Unternehmen ausgeschlossen, die in den folgenden kontroversen Geschäftsfeldern tätig sind und Umsätze durch die Involvierung in folgenden Geschäftsfeldern generieren:

–Kontroverse/geächtete Waffen (z.B. Landminen, Streubomben, Massenvernichtungswaffen)

–Einstufung „Rot“ bei Kontroversen in Bezug auf die Umwelt (*Environmental Controversy Flag: Bei diesem Indikator geht es um die Bewertung von Kontroversen (falls vorhanden) im Zusammenhang mit den Auswirkungen eines Unternehmens auf die Umwelt. Zu den Faktoren, die sich auf diese Bewertung auswirken, gehört, ob ein Unternehmen in Kontroversen im Zusammenhang mit Landnutzung und Biodiversität, Freisetzung von Giftstoffen, Energie und Klimawandel, Wassermanagement, nicht gefährlichen Betriebsabfällen, Umweltauswirkungen von Produkten und Dienstleistungen und dem Management der Umweltauswirkungen der Lieferkette verwickelt ist.*)

–Einstufung „Rot“ bei Kontroversen in Bezug auf das Klima (*Environment Climate Flag: Dieser Indikator misst die Schwere der Kontroversen im Zusammenhang mit der Politik und den Initiativen eines Unternehmens im Bereich Klimawandel und Energie. Zu den Faktoren, die sich auf diese Bewertung auswirken, gehören unter anderem eine frühere Verwicklung in Rechtsfälle im Zusammenhang mit Treibhausgasen, weit verbreitete oder ungeheuerliche Auswirkungen aufgrund von Treibhausgasemissionen des Unternehmens, Widerstand gegen verbesserte Praktiken und Kritik von NGO's und/oder anderen Beobachtern.*)

–Rüstungsgüter

(Ausschluss, wenn Umsatz > 5% von Gesamtumsatz.)

–Kraftwerkskohle

(Ausschluss, wenn Umsatz > 30% von Gesamtumsatz aus Produktion und/oder Vertrieb.)

–Tabakwaren

(Ausschluss, wenn Umsatz > 5% von Gesamtumsatz aus Produktion und/oder Vertrieb.)

Zum anderen werden Unternehmen ausgeschlossen, die kontroverse Geschäftspraktiken verfolgen. Dazu gehören Unternehmen, die eindeutig und ohne Aussicht auf positive Veränderung gegen eines oder mehrere der zehn Prinzipien des „Global Compact der Vereinten Nationen“ verstoßen (im Internet unter <https://www.unglobalcompact.org/what-is-gc/mission/principles> verfügbar). Diese bestehen aus Vorgaben hinsichtlich Menschen- und Arbeitsrechten sowie hinsichtlich Umweltschutz sowie Korruption.

Ergänzend werden Staatsemitenten ausgeschlossen, die ein unzureichendes Scoring (Ausschluss, wenn Einstufung „Not free“) nach dem Freedom House Index (<https://freedom->

house.org/) und/oder nach den World Bank Governance Indikatoren (<https://info.worldbank.org/governance/wgi/>) vorweisen.

Die vorgenannten Ausschlüsse gelten nur bei direkten Investitionen.

Vom Erwerb ausgeschlossen sind Zielfonds, die Investitionen zu mehr als 0,49% in Emittenten enthalten, die

- eindeutig und ohne Aussicht auf positive Veränderung gegen eines oder mehrere der zehn Prinzipien des „Global Compact der Vereinten Nationen“ verstoßen
- mehr als 10% ihres Umsatzes mit Rüstungsgütern erzielen
- mehr als 30% vom Gesamtumsatz aus Produktion und/oder Vertrieb mit Kraftwerkskohle generieren
- mehr als 5% vom Gesamtumsatz aus Produktion und/oder Vertrieb mit Tabak erzielen
- die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (Staatsemittenten)

Die vorgenannte Schwelle von 0,49% bezieht sich jeweils auf das einzelne Ausschlusskriterium.

Ferner sind Zielfonds vom Erwerb ausgeschlossen, die Investitionen zu mehr als 0% in Unternehmen enthalten, die

- Kontroverse/geächtete Waffen (z.B. Landminen, Streubomben, Massenvernichtungswaffen) herstellen

Die Einhaltung der Ausschlusskriterien sowie der vorgenannten Mindestquoten wird durch die Gesellschaft mit Hilfe ihrer intern verwendeten Systeme und Kontrollen sichergestellt.

Weitere Informationen können den Abschnitten „ESG-Integration“, „Berücksichtigung von nachteiligen Nachhaltigkeitsauswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren“ sowie „Berücksichtigung von Nachhaltigkeitsrisiken“ des Verkaufsprospektes entnommen werden.

● **Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Teilfonds strebt eine Mindestquote von 15% des Teilfondsvermögens in nachhaltigen Investitionen im Sinne von Art. 2 Ziff. 17 der Offenlegungs-Verordnung an. Nachhaltige Investitionen im vorgenannten Sinne sind Investitionen in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels beiträgt, gemessen beispielsweise an Schlüsselindikatoren für Ressourceneffizienz bei der Nutzung von Energie, erneuerbarer Energie, Rohstoffen, Wasser und Boden, für die Abfallerzeugung, und Treibhausgasemissionen oder für die Auswirkungen auf die biologische Vielfalt und die Kreislaufwirtschaft, oder eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines sozialen Ziels beiträgt, insbesondere eine Investition, die zur Bekämpfung von Ungleichheiten beiträgt oder den sozialen Zusammenhalt, die soziale Integration und die Arbeitsbeziehungen fördert oder eine Investition in Humankapital oder zugunsten wirtschaftlich oder sozial benachteiligter Bevölkerungsgruppen, vorausgesetzt, dass diese Investitionen keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigen und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden, insbesondere bei soliden Managementstrukturen, den Beziehungen zu den Arbeitnehmern, der Vergütung von Mitarbeitern sowie der Einhaltung der Steuervorschriften.

Der positive Beitrag einer nachhaltigen Investition wird anhand einer oder mehrerer festgelegter Sustainable Development Goals („SDGs“) der Vereinten Nationen gemessen. Hierbei werden Daten von MSCI ESG Research LLC verwendet. Derzeit sind es

- Ziel 5 - Gleichstellung der Geschlechter – Geschlechtergleichstellung erreichen und alle Frauen und Mädchen zur Selbstbestimmung befähigen,
- Ziel 8 - Nachhaltiges Wirtschaftswachstum und menschenwürdige Arbeit für alle – dauerhaftes, breitenwirksames und nachhaltiges Wirtschaftswachstum, produktive Vollbeschäftigung und menschenwürdige Arbeit für alle fördern,
- Ziel 12 - Nachhaltige Konsum- und Produktionsweisen – nachhaltige Konsum- und Produktionsmuster sicherstellen und
- Ziel 13 - Sofortmaßnahmen ergreifen, um den Klimawandel und seine Auswirkungen zu bekämpfen

Ein positiver Beitrag ist gegeben, sofern das Netto-Scoring des Zielunternehmens, dass durch MSCI ESG Research LLC einen Wert von -10 bis +10 zugeordnet werden kann, einen Wert von größer oder gleich 2 erhält und ein positiver Umsatz des Unternehmens aus den Bereichen:

- mit Umweltauswirkungen, darunter alternative Energie, Energieeffizienz, grünes Bauen, Vermeidung von Umweltverschmutzung, nachhaltige Wasserwirtschaft oder nachhaltige Landwirtschaft oder
- mit sozialer Wirkung, darunter Ernährung, Abwasserentsorgung, Behandlung schwerer Krankheiten, KMU-Finanzierung, Bildung, erschwingliche Immobilien oder Konnektivität.

stammt.

Sollte kein Netto-Scoring in Bezug auf die gewählten SDGs vorhanden sein, so ist die Einwertung für den positiven Beitrag ausreichend, wenn ein positiver Umsatz des Unternehmens aus den vorgenannten Bereichen vorliegt.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, ökologisch oder sozialen nachhaltigen Anlageziele nicht erheblich geschadet?

Im Rahmen der Überprüfung, ob sich ein Einzeltitel als nachhaltige Investition qualifiziert erfolgt eine Prüfung des „nicht schädigen“ bzw. der „erheblichen Beeinträchtigung“ anhand diverser Datenfelder, die sich u.a. auf die wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsauswirkungen beziehen.

Ein „schädigen“ bzw. „erheblich beeinträchtigen“ könnte bspw. aufgrund von Kontroversen in den Bereichen Umwelt und/oder Soziales des Unternehmens oder durch die Tätigkeit des Unternehmens selbst vorliegen.

Beispielsweise kann sich eine Investition in ein Unternehmen, dass im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig ist oder mit negativen Kontroversen in Bezug auf Umwelt, Soziales und/oder Unternehmensführung behaftet ist, nicht als nachhaltige Investition qualifizieren.

Zudem darf das Netto-Scoring einer oder mehrerer festgelegter Sustainable Development Goals („SDGs“) der Vereinten Nationen, das durch MSCI ESG Research LLC bewertet wird, nicht unter -2 liegen. Derzeit sind es

- Ziel 5 - Gleichstellung der Geschlechter – Geschlechtergleichstellung erreichen und alle Frauen und Mädchen zur Selbstbestimmung befähigen,
- Ziel 8 - Nachhaltiges Wirtschaftswachstum und menschenwürdige Arbeit für alle – dauerhaftes, breitenwirksames und nachhaltiges Wirtschaftswachstum, produktive Vollbeschäftigung und menschenwürdige Arbeit für alle fördern,
- Ziel 12 - Nachhaltige Konsum- und Produktionsweisen – nachhaltige Konsum- und Produktionsmuster sicherstellen und

- Ziel 13 - Sofortmaßnahmen ergreifen, um den Klimawandel und seine Auswirkungen zu bekämpfen

— — *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Den einzelnen Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren werden diverse Datenfelder von MSCI ESG Research LLC zugeordnet. Bei nachhaltigen Investitionen müssen diese einen gewissen Wert erreichen bzw. es darf kein vordefinierter Wert unterschritten werden. Die angewandte Methodik kann Änderungen und/oder Anpassungen unterliegen.

Beispielweise wird für die Indikatoren

- THG-Emissionen
- CO2-Fußabdruck
- THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird
- Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
- Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren

die Einstufung der Kontroversen auf das Klima (*Environment Climate Flag: Dieser Indikator misst die Schwere der Kontroversen im Zusammenhang mit der Politik und den Initiativen eines Unternehmens im Bereich Klimawandel und Energie. Zu den Faktoren, die sich auf diese Bewertung auswirken, gehören unter anderem eine frühere Verwicklung in Rechtsfälle im Zusammenhang mit Treibhausgasen, weit verbreitete oder ungeheuerliche Auswirkungen aufgrund von Treibhausgasemissionen des Unternehmens, Widerstand gegen verbesserte Praktiken und Kritik von NGO's und/oder anderen Beobachtern.*) überprüft. Entsprechend darf hier keine Einstufung „Rot“ oder „Orange“ erfolgen. „Rot“ weist auf eine laufende sehr schwerwiegende ESG-Kontroverse hin, in die ein Unternehmen direkt durch seine Handlungen, Produkte oder Tätigkeiten verwickelt ist. „Orange“ weist auf eine schwerwiegende laufende Kontroverse hin, in die das Unternehmen direkt involviert ist, oder auf eine sehr schwerwiegende Kontroverse, die entweder teilweise gelöst ist oder indirekt auf die Handlungen, Produkte oder Tätigkeiten des Unternehmens zurückzuführen ist.

In Bezug auf den Indikator

- Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind

darf der Emittent nicht mit „Ja“ gekennzeichnet sein, da er sonst die Anforderungen an eine nachhaltige Investition nicht erfüllt.

Weitere Informationen zu dem Verfahren können bei der Verwaltungsgesellschaft angefragt werden.

— — *Wie stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Für eine mögliche Einstufung als nachhaltige Investition kommen nur Unternehmen in Frage, die in Bezug auf die Einhaltung des UN Global Compact mit „Pass“ kategorisiert sind. „Pass“ gibt einen Hinweis darauf, dass das Unternehmen in keine ESG-Kontroversen verwickelt ist oder seine Verwicklung auf der Grundlage der Methodik des Datenanbieters als nicht umfangreich oder nicht sehr schwerwiegend eingestuft wird.

Weitere Informationen zu dem Verfahren können bei der Verwaltungsgesellschaft angefragt werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?



Ja,

Der Fondsmanager des Teilfonds berücksichtigt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (sogenannte „principle adverse impacts“ („PAI's“)) von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren im Sinne des Artikel 7 Absatz 1 a) der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor. Nachhaltigkeitsfaktoren werden in diesem Sinne definiert als Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte und die Bekämpfung von Korruption und Bestechung. Dies gilt nur bei direkten Investitionen.

Die aufgeführten PAI's entsprechen denen, die in Anhang I Tabelle 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 vom 6. April 2022 der Kommission zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf technische Regulierungsstandards zur Festlegung der Einzelheiten des Inhalts und der Darstellung von Informationen in Zusammenhang mit dem Grundsatz der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen, des Inhalts, der Methoden und der Darstellung von Informationen in Zusammenhang mit Nachhaltigkeitsindikatoren und nachteiligen Nachhaltigkeitsauswirkungen sowie des Inhalts und der Darstellung von Informationen in Zusammenhang mit der Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale und nachhaltiger Investitionsziele in vorvertraglichen Dokumenten, auf Internetseiten und in regelmäßigen Berichten, genannt sind und lauten:

- THG-Emissionen
- CO2-Fußabdruck
- THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird
- Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
- Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
- Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.