

DJE – Dividende & Substanz LEI : 52990096TZHQSL9DD593

Zusammenfassung

1. Kein nachhaltiges Investitionsziel

Mit diesem Finanzprodukt werden ökologische oder soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen angestrebt.

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

Der Fondsmanager verfolgt dabei einen Best-in-class-Ansatz unter Berücksichtigung von Ausschlüssen von Unternehmen, die gegen gewisse Prinzipien verstoßen zwecks Reduzierung möglicher negativer Auswirkungen auf die Umwelt und Soziales.

Werden für diesen Teilfonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (sogenannte „principle adverse impacts“ („PAI´s“)) von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Ja
 Nein

2. Ökologische oder soziale Merkmale des Finanzprodukts

Ausschlusskriterien

ESG-Integration

Nachhaltige Investitionen

[andere]

3. Anlagestrategie

Die Zusammenstellung des Portfolios erfolgt, 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.

Die Gesellschaft berücksichtigt bei der Verwaltung des Teilfonds unter anderem ökologische und/ oder soziale Merkmale und investiert in Unternehmen, die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden. Der Fondsmanager verfolgt dabei einen Best-in-class-Ansatz unter Berücksichtigung, der in der Anlagepolitik des Teilfonds aufgeführten Ausschlüsse und Mindestquoten.

Zur Erreichung der Anlageziele wird das Teilfondsvermögen überwiegend in börsennotierte oder an einem anderen geregelten Markt, der regelmäßig stattfindet, anerkannt und der Öffentlichkeit zugänglich ist, gehandelte Aktien investiert.

Darüber hinaus kann der Teilfonds auch in börsennotierte oder an einem anderen geregelten, Markt, der regelmäßig stattfindet, anerkannt und der Öffentlichkeit zugänglich ist, gehandelte fest- und variabel verzinsliche Wertpapiere investieren.

Der Fondsmanager verfolgt bei der Auswahl der Aktien den Value – Ansatz. Hierunter versteht man Aktien, die aus fundamentaler Sicht unterbewertet sind und ein dementsprechendes Kurspotential aufweisen, bzw. eine überdurchschnittliche Dividendenrendite in ihrem Marktsegment besitzen. Ausführliche Informationen zur Anlagepolitik des Teilfonds können aus dem Verkaufsprospekt des Teilfonds entnommen werden.

4. Aufteilung der Investitionen

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.

Andere Investitionen (u.a. Bankguthaben, Derivate etc.) sind auf 35% begrenzt.

5. Überwachung der ökologischen oder sozialen Merkmale

Die Einhaltung der unter „Anlagestrategie“ und „Beschreibung der ökologischen oder sozialen Merkmale“ aufgeführten Ausschlüsse sowie Mindestquoten wird im Pre-Trade Verfahren durch Negativlisten und Positivlisten, die im Ordermanagementsystem hinterlegt und mindestens quartalsweise aktualisiert werden, geprüft. Im Post-Trade Verfahren werden die Daten von MSCI ESG Research LLC wöchentlich aktualisiert. Nachfolgend sind in die im Anlageprozess integrierten Nachhaltigkeitsindikatoren aufgeführt:

Ausschlusskriterien

ESG-Integration

Nachhaltige Investitionen [andere]

6. Methoden für ökologische oder soziale Merkmale

Für den Teilfonds werden folgende Methoden angewendet um den beschriebenen Best-in-class Ansatz und die aufgeführten Ausschlüsse zu prüfen. Für die Ausschlüsse werden Negativlisten mit Hilfe der Daten von MSCI ESG Research LLC erstellt:

<input checked="" type="checkbox"/> Ausschlusskriterien	Definierte Ausschlusskriterien werden mit Hilfe von externen Datenfeldern für alle Investitionen des Portfolios geprüft (Negativ-Liste).
<input checked="" type="checkbox"/> ESG-Integration	Der Fondsmanager verfolgt dabei einen Best-in-class-Ansatz unter Berücksichtigung von Ausschlüssen von Unternehmen, die gegen gewisse Prinzipien verstoßen zwecks Reduzierung möglicher negativer Auswirkungen auf die Umwelt und Soziales.
<input checked="" type="checkbox"/> Nachhaltige Investitionen	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 (im Sinne des Artikel 2 (17) SFDR). 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.

7. Datenquellen und -verarbeitung

Im Rahmen des Best-in-class Ansatzes werden potenzielle Unternehmen mit Hilfe einer hauseigenen Ratingmethodik, die auf externen ESG-Daten (MSCI ESG Research LLC.) als auch eigenen Research-Ergebnissen basiert, bewertet. Der Fondsmanager kann die vorhandenen Daten im Zweifelsfall einer Überprüfung durch ein Gremium unterziehen.

8. Beschränkungen hinsichtlich der Methoden und Daten

Die Methoden und Daten sind dahingehend eingeschränkt, dass nicht zu allen Titeln 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.

Titel ohne Daten fallen in den Bereich von „anderen Investitionen“, die nicht mehr als 35% des Teilfondsvermögens ausmachen dürfen. Darunter fallen zudem Bankguthaben und Derivate.

9. Investitions-Prüfung (Sorgfaltspflicht)

Der Teilfonds unterliegt dem Investitionsprozess des Fondsmanagers:

1/ Titelauswahl: Der Titelauswahlprozess umfasst die Kategorien Analysteneinschätzung, Unternehmensgespräch, Nachhaltigkeits-/ESG-Kriterien, Bewertung, Momentum sowie Sicherheit & Liquidität. In jeder Kategorie wird ein Score in der Bandbreite von -10 bis +10 vergeben, wobei -10 die schlechteste Einstufung darstellt und +10 die beste. Alle sechs Kategorien sind im Standardprozess gleichgewichtet.

2/ Ausschlüsse: Durch die angewandten Ausschlusskriterien wird das potenzielle Anlageuniversum reduziert.

10. Mitwirkungspolitik

Die Mitwirkungspolitik der DJE Investment S.A. können Anleger kostenlos auf der Internetseite www.dje.lu unter der Rubrik „Rechtliche Hinweise“ abrufen.

11. Bestimmter Referenzwert

Für den Teilfonds wurde kein Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist.

Ausführliche Informationen können aus dem Gesamtdokument „Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungen Transparenz bei der Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale“, dass unter <https://www.dje.de/transparenz-bei-dje-dividende-und-substanz> veröffentlicht ist, entnommen werden.