

Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungen

Name des Produkts: Basis-Fonds I Nachhaltig

Unternehmenskennung (Lei-Code): 529900N0QUASPR63HO30

ZUSAMMENFASSUNG

●● <input type="checkbox"/> Ja	●● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: N/A <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: N/A	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es nachhaltigen Investitionen <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

Der Fonds fördert ökologische und/oder soziale Merkmale. Dies spiegelt sich in der Konstruktion und der Gewichtung des Portfolios aufgrund des ESG-Ratingprozesses, der Berücksichtigung von externem Research und Daten wider. Einzelheiten der Anlagestrategie sind im Verkaufsprospekt des Fonds und hier insbesondere im Anhang „Ökologische und/oder soziale Merkmale“ dargestellt, in welchem die vorvertraglichen Informationen für ein in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genanntes Finanzprodukt offengelegt sind. Wesentliche nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren werden bei Investitionsentscheidungen insbesondere durch Einhaltung der Ausschlusspolitik der Gesellschaft berücksichtigt. Der Fonds fördert Klimaschutz und Anpassung an den Klimawandel. Die Einhaltung der ESG-bezogenen Anlagerichtlinien wird von der unabhängigen Risikocontrolling Einheit kontrolliert. Die Methodologie für die Analyse und Bewertung ökologischer oder sozialer Merkmale des Fonds beruht auf dem ESG-Modell der Gesellschaft. Je nach Assetklasse und Strategie beruht dieses ESG-Modell ganz oder nur teilweise auf der Methodologie von MSCI bzw. MSCI Daten. Die Gesellschaft verwendet keine Schätzungen von Taxonomiedaten. Alle für den Fonds erworbenen Direktinvestitionen unterliegen den für den Fonds geltenden Mindestausschlüssen, die ein Mindestmaß an ökologischem oder sozialem Schutz gewährleisten.

KEIN NACHHALTIGES INVESTITIONSZIEL

Mit diesem Finanzprodukt werden ökologische oder soziale Merkmale befördert.

Der folgende Ansatz ist so definiert, dass er mit Artikel 2 (17) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“) übereinstimmt.

- **Von der Investition ausgeschlossene Sektoren:** Die Ausschlusspolitik von ODDO BHF Asset Management wird angewandt, um Sektoren auszuschließen, die die größten negativen Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsziele haben. Der Fonds investiert nicht in Emittenten, welche an der Herstellung und dem Vertrieb von nicht konventionellen Waffen beteiligt sind. Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in Emittenten aus kontroversen Geschäftsfeldern, wenn sie eine bestimmte Umsatzschwelle überschreiten.

Dies sind Kohle, Tabak, Glücksspiel, Erwachsenenunterhaltung, gentechnisch veränderte Organismen (GVO), konventionelle Waffen oder die Förderung fossiler Brennstoffe in der Arktis. Darüber hinaus werden Emittenten aus den folgenden Sektoren ausgeschlossen, die ihren Umsatz zu mehr als 5 Prozent aus der Erschließung, Förderung und Nutzung von unkonventionellem Öl und Gas (Schieferöl und -gas sowie Ölsande) oder zu mehr als 5 Prozent aus der Förderung von Kohle und Erdöl generieren oder die ihren Umsatz zu mehr als 10 Prozent aus der Energiegewinnung oder dem sonstigen Einsatz von fossilen Brennstoffen (exklusive Gas) oder Atomstrom generieren.

- **Kontroversen:** Die laut MSCI ESG-Research umstrittensten Unternehmen werden durch das ESG-Team, auf Basis einer zweiten Prüfung, als nicht nachhaltig eingestuft.

- **Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen:** Um die Nachhaltigkeitsziele nicht wesentlich zu beeinträchtigen, legt der Fondsmanager Kontrollregeln (vor dem Handel) für ausgewählte, wesentlich schädliche Aktivitäten fest: Umgang mit umstrittenen Waffen (0 % Toleranz), Aktivitäten, die sich negativ auf die Biodiversität auswirken (0 % Toleranz), und schwerwiegende Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact und die Richtlinien der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (0 % Toleranz).

- **Dialog, Engagement und Abstimmung:** Unsere Politik des Dialogs, des Engagements und der Abstimmung unterstützt das Ziel, erheblichen Schaden zu vermeiden, indem wir die wichtigsten Risiken identifizieren und uns Gehör verschaffen, um Veränderungen und Verbesserungen zu bewirken.

Die Verordnung (EU) 2020/852 definiert bestimmte Bereiche, die nachteilige Auswirkungen haben können ("PAI").

Der Fondsmanager wendet Vorhandelsregeln für drei PAI an:

- Engagement in umstrittenen Waffen (PAI 14 und 0 % Toleranz),

- Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (PAI 7 und 0 % Toleranz)

- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (PAI 10 und 0 % Toleranz).

Darüber hinaus bezieht der Fondsmanager andere PAI in seine ESG-Analyse für Unternehmen ein, bei denen die Informationen verfügbar sind, aber keine zwingenden Ausschlussvorschriften bestehen. Die Sammlung von PAI-Daten dient der Festlegung des endgültigen ESG-Ratings. Die ESG-Analyse umfasst die Überwachung der Treibhausgasemissionen (PAI 1), das Engagement in fossilen Brennstoffen (PAI 4), der Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energien (PAI 5), die Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (PAI 6), das Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung des UN Global Compact und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (PAI 11), das unbereinigte geschlechtsspezifische Verdienstgefälle (PAI 12) und die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (PAI 13). Darüber hinaus werden zwei weitere zusätzliche PAI einbezogen: Entwaldung (zusätzlicher PAI 15) und Fehlende Menschenrechtspolitik (zusätzlicher PAI 9). Wenn der Fonds in Staaten investiert, bezieht das ESG-Modell der Gesellschaft die beiden wichtigsten PAI in die ESG-Analyse ein: Treibhausgasemissionsintensität (PAI 15) und Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (PAI 16).

Weitere Informationen über die Berücksichtigung von PAI finden Sie unter am.oddobhf.com.

Die Gesellschaft stellt sicher, dass die nachhaltigen Anlagen des Fonds mit der nach Kriterien des United Nations Global Compact (UNGC) aufgestellten Ausschlussliste übereinstimmen, wie in der Ausschlusspolitik der Gesellschaft näher beschrieben. Nachgewiesene Verstöße gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und/oder die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte führen ebenfalls zum Ausschluss.

ÖKOLOGISCHE ODER SOZIALE MERKMALE DES FINANZPRODUKTS

Der Fonds fördert Klimaschutz und Anpassung an den Klimawandel durch nachhaltige Investitionen nach der EU-Taxonomie und nachhaltige Investitionen gemäß Art. 2 Nr. 17 SFDR.

Mit den nachhaltigen Investitionen des Fonds werden folgende Ziele verfolgt:

1. **Nachhaltige Investitionen nach der EU-Taxonomie:** Der Beitrag zum Klimaschutz und zur Anpassung an

den Klimawandel sowie zu den vier anderen Umweltzielen der EU-Taxonomie. Dieser Beitrag wird durch die gewichtete Summe der an der EU-Taxonomie ausgerichteten Erträge jeder Investition im Portfolio nachgewiesen und basiert auf den von den Unternehmen, in die investiert wird, veröffentlichten Daten.

2. Nachhaltige Investitionen: Der Beitrag zu den Umweltauswirkungen, wie er im MSCI ESG-Research durch das Feld "Nachhaltige Auswirkungen" in Bezug auf die Umweltziele definiert ist. Der Sustainable Impact Revenue Indicator von MSCI ESG Research bewertet die Ausrichtung der Erträge von Unternehmen auf Umweltthemen, wie z.B.: alternative Energien, Energieeffizienz, umweltfreundliches Bauen, nachhaltige Wasserversorgung, Vermeidung und Bekämpfung von Umweltverschmutzung und nachhaltige Landwirtschaft, aber ohne den Rahmen der EU-Taxonomie. Dies ermöglicht es, die Ausrichtung von Wirtschaftstätigkeiten auf ökologisch nachhaltige Investitionsziele zu rechtfertigen, die nicht mit der EU-Taxonomie übereinstimmen.

ANLAGESTRATEGIE

Der Fonds legt aktiv in verzinsliche Wertpapiere mit kürzeren Laufzeiten an. Als Anlagen kommen vor allem Staatsanleihen, Covered Bonds sowie Unternehmensanleihen, welche auf Euro lauten, in Betracht. Es wird auf eine hohe Kreditwürdigkeit der Schuldner geachtet. Anleihen in Fremdwährungen können in einem begrenzten Umfang beigemischt werden, ebenso Aktien. Der aktive Investmentprozess basiert auf Fundamentalanalysen, welche eine Beurteilung des makroökonomischen Umfelds sowie eine Bonitätsanalyse der jeweiligen Emittenten beinhalten. Zudem werden die Duration und die Renditekurvenposition des Portfolios sowie die Gewichtung der einzelnen Anleihenmarktsegmente auf der Grundlage von Top-Down- Analysen flexibel an die jeweilige Marktsituation angepasst. Für das OGAW-Sondervermögen werden finanzielle Kriterien und die Merkmale Umwelt, Soziales und gute Unternehmensführung (ESG-Merkmale) im Rahmen der Analyse und Bewertung der Emittenten einbezogen. Dabei werden mindestens 75 Prozent der Vermögensgegenstände bzw. Emittenten in Bezug auf ESG analysiert und bewertet. Im Rahmen der ESG-Strategie werden die derzeitigen und künftigen Nachhaltigkeitsaktivitäten von Emittenten analysiert und Nachhaltigkeitschancen und -risiken bei der Anlageentscheidung einbezogen sowie die wesentlichen negativen Auswirkungen von Anlageentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Die Gesellschaft beachtet zudem die Prinzipien für verantwortliches Investieren der Vereinten Nationen ("UN PRI") in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Fragen und wendet diese auch im Rahmen ihres Engagements an, z. B. durch die Ausübung von Stimmrechten, die aktive Wahrnehmung von Aktionärs- und Gläubigerrechten und den Dialog mit Emittenten. Emittenten, welche an der Entwicklung, Herstellung und dem Vertrieb von nicht konventionellen Waffen beteiligt sind, werden vollständig ausgeschlossen. Darüber hinaus werden Emittenten aus kontroversen Geschäftsfeldern ausgeschlossen, wenn sie eine bestimmte Umsatzschwelle überschreiten. Dies sind Kohle, Tabak, Glücksspiel, Erwachsenenunterhaltung, gentechnisch veränderte Organismen (GVO), konventionelle Waffen oder die Förderung fossiler Brennstoffe in der Arktis. Darüber hinaus werden Emittenten aus den folgenden Sektoren ausgeschlossen, die ihren Umsatz zu mehr als 5 Prozent aus der Erschließung, Förderung und Nutzung von unkonventionellem Öl und Gas (Schieferöl und -gas sowie Ölsande) oder zu mehr als 5 Prozent aus der Förderung von Kohle und Erdöl generieren oder die ihren Umsatz zu mehr als 10 Prozent aus der Energiegewinnung oder dem sonstigen Einsatz von fossilen Brennstoffen (exklusive Gas) oder Atomstrom generieren. Unternehmen mit nachgewiesenen Verstößen gegen die Prinzipien des UN Global Compact werden ebenfalls ausgeschlossen. Der Ansatz zur Einbeziehung von ESG-Kriterien kombiniert die Ansätze „Best-in-Universe“ und „Best-in-Effort“. Es werden u.a. die folgenden Kriterien analysiert: Umwelt (Klimarisikomanagement, Energieverbrauch, Wasserverbrauch, Abfallmanagement, Umweltzertifizierungen, Produkte und Dienstleistungen mit ökologischem Mehrwert oder Klimarisikomanagement), Soziales (Humankapital- Personalmanagement, Diversität von Managementteams, Mitarbeiterschulung, Gesundheit und Sicherheit, Management von Lieferanten oder Innovation) sowie Unternehmensführung (Corporate Governance- Wahrung der Interessen von Minderheitsaktionären, Zusammensetzung der Leitungsorgane, Vergütungspolitik, Steuerverantwortung oder Gefährdung durch Korruptionsrisiken). Die dem Fonds zugeführten Vermögensgegenstände unterliegen bei der Anwendung von Nachhaltigkeits- und Umweltkriterien einem internen ESG-Ratingsystem, auf Basis einer internen Bewertungsskala. Diese ist in fünf Stufen unterteilt (5 ist die beste und 1 die schlechteste): Starke ESG-Chance (5), ESG-Chance (4), neutrales ESG-Risiko (3), moderates ESG-Risiko (2) und hohes ESG-Risiko (1). Es können auch zusätzlich externe Ratings zur Bewertung herangezogen werden. Unternehmen mit einem internen Rating von (1) oder Unternehmen ohne ein internes Rating und mit einem MSCI ESG Rating unter B werden ausgeschlossen. Zudem dürfen Wertpapiere von Staaten, welche für den Fonds erworben werden (Direktinvestment), kein unzureichendes Scoring nach dem Freedom House Index aufweisen.

Mindestens 75 % der Vermögensgegenstände (exklusive Bankguthaben) im Portfolio verfügen- unter Berücksichtigung der Gewichtung einzelner Vermögensgegenstände- über ein ESG-Rating.

Alle für den Fonds erworbenen Direktinvestitionen unterliegen den für den Fonds geltenden Mindestausschlüssen, die ein Mindestmaß an ökologischem oder sozialem Schutz gewährleisten. Es findet jedoch keine Durchschau durch einzelne Finanzinstrumente statt (keine Durchschau auf Vermögensanlagen eines Zielfonds oder von Zertifikaten).

AUFTEILUNG DER INVESTITIONEN

Mindestens 75 % des Nettoinventarwertes des Fonds sind auf ökologische und/oder soziale Merkmale ausgerichtet. Der Fonds kann auch bis zu 25 % seines Nettoinventarwertes in „Andere Investitionen“ halten, die die übrigen Investitionen des Fonds umfassen, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Mindestens 10 % des Nettoinventarwertes des Fonds werden in nachhaltige Investitionen investiert. Der Fonds kann auch Vermögenswerte halten, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Mindestens 0,5 % des Nettoinventarwertes des Fonds werden in taxonomiekonforme Investitionen getätigt. Es gibt keine Mindestverpflichtung für andere ökologisch oder sozial ausgerichtete Investitionen.

Mindestens 75 % der Vermögensgegenstände (exklusive Bankguthaben) im Portfolio verfügen- unter Berücksichtigung der Gewichtung der einzelnen Vermögensgegenstände- über ein ESG-Rating. Zielfonds mit einem ESG-Rating auf Fondsebene werden ebenfalls berücksichtigt.

ÜBERWACHUNG DER ÖKOLOGISCHEN ODER SOZIALEN MERKMALE

Das Risiko Management Team der Gesellschaft ist für die interne Kontrolle der Anlagerichtlinien des Fonds verantwortlich. Diese umfassen die ökologischen und/oder sozialen Merkmale des Fonds. Die Fondsmanager überwachen regelmäßig die ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds.

METHODEN

Die Methodologie für die Analyse und Bewertung ökologischer oder sozialer Merkmale des Fonds beruht auf dem ESG-Modell der Gesellschaft. Je nach Assetklasse und Strategie beruht dieses ESG-Modell ganz oder nur teilweise auf der Methodologie von MSCI bzw. MSCI Daten. Mehr Informationen sind verfügbar unter: [Nachhaltiges Investieren](#)

DATENQUELLEN UND -VERARBEITUNG

Die Gesellschaft benutzt verschiedene Datenquellen in ihrem ESG-Modell, um die Analyse und Bewertung ökologischen oder sozialen Merkmalen durchzuführen und zu unterlegen. Diese Daten stammen aus externen Datenquellen wie MSCI, CDP, Carbon 4 Finance (Daten für Biodiversität) und Bloomberg, und sind durch interne Analysen ergänzt. Taxonomiedaten werden über Refinitiv bezogen. Die Gesellschaft verwendet keine Schätzungen von Taxonomiedaten.

Die Daten unterliegen einem internen Qualitätscheck. Die Gesellschaft stellt die Datenqualität und -konsistenz sicher, indem sie regelmäßige Besprechungen mit ihren Datenanbietern führt, um etwaige Fehler zu korrigieren, mögliche Verbesserungen zu empfehlen und Rückmeldungen aus Investoren- oder Unternehmensgesprächen zu geben. Die Datenverarbeitung erfolgt über Datenimporte in die IT-Systeme der Gesellschaft.

BESCHRÄNKUNGEN HINSICHTLICH DER METHODEN UND DATEN

Alle Rechte an den von Datenlieferanten bereitgestellten Daten und Berichten liegen bei diesen Datenlieferanten und/oder ihren Inhaltsanbietern. Keiner dieser Datenlieferanten oder deren verbundene Unternehmen oder deren Inhaltsanbieter übernehmen eine Haftung für Fehler, Auslassungen oder Unterbrechungen in solchen Daten/Berichten in Bezug auf Vollständigkeit, Genauigkeit oder Aktualität. Das Kopieren oder Weiterverbreiten solcher Daten/Berichte ist ohne die ausdrückliche schriftliche Zustimmung dieser Datenlieferanten nicht gestattet. Der Manager steht regelmäßig in Kontakt mit seinen Datenlieferanten, um die Qualität und Zuverlässigkeit der verwendeten Daten sicherzustellen. Die Gesellschaft verwendet keine Schätzungen von Taxonomiedaten. Dem Fondsmanager stehen somit eine Reihe von externen Datenquellen nach interner Überprüfung zur Verfügung, welche die Gesellschaft grundsätzlich für zuverlässig hält.

SORGFALTSPFLICHT

Die Due-diligence Prozesse unterliegen einer grundsätzlichen Analyse durch den Fondsmanager. Zusätzlich werden interne ESG-Ratings verwendet. Die ESG Anlagegrenzen werden durch die unabhängige Kontrollabteilung Investment Controlling überwacht.

Alle für den Fonds erworbenen Direktinvestitionen unterliegen den für den Fonds geltenden Mindestausschlüssen, die ein Mindestmaß an ökologischem oder sozialem Schutz gewährleisten. Es findet jedoch keine Durchschau durch einzelne Finanzinstrumente statt (kein Look-Through auf Vermögensanlagen eines Zielfonds oder von Zertifikaten).

MITWIRKUNGSPOLITIK

Die Mitwirkungspolitik der Gesellschaft ist verfügbar unter: [Regulatorische Informationen](#)

BESTIMMTER REFERENZWERT

Für den Fonds wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob der Fonds auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist.