

## Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungen

# MAINFIRST - ABSOLUTE RETURN MULTI ASSET

Morningstar Sustainability Rating™



## ZUSAMMENFASSUNG

Um den ökologischen und sozialen Merkmalen gerecht zu werden nutzt das Produkt eine Kombination aus Ausschlusskriterien und einem Scoring-basierten Ansatz. Der MainFirst Absolute Return Multi Asset soll im Durchschnitt ein mittleres oder besseres ESG-Risiko Profil aufzeigen. Dazu ziehen wir die Analysen der externen Ratingagentur Sustainalytics heran. Nicht-finanzielle Faktoren wie die Berücksichtigung ethischer, sozialer und ökologischer Kriterien (ESG), insbesondere im Hinblick auf Reputationsrisiken werden aktiv in die Anlage- und Entscheidungsprozesse mit einbezogen.





## KEIN NACHHALTIGES INVESTITIONSZIEL

Dieses Finanzprodukt berücksichtigt ökologische oder soziale Merkmale, verfolgt jedoch nicht das primäre Ziel einer nachhaltigen Investition im Sinne der EU-Taxonomie-Verordnung (2020/852).

## ÖKOLOGISCHE ODER SOZIALE MERKMALE DES FINANZPRODUKTS

Der MainFirst Absolute Return Multi Asset soll im Durchschnitt ein mittleres oder besseres ESG-Risiko Profil aufzeigen. Dazu ziehen wir den ESG-Risiko-Score der externen Ratingagentur Sustainalytics heran.

Des Weiteren wird der Nachhaltigkeitsanspruch des MainFirst Absolute Return Multi Asset durch den Ausschluss der folgenden Sektoren bestätigt:

 <p><b>UMWELT SCREENING AUSSCHLUSS:</b> Öl &amp; Gas, Ölsande / Schiefergas, Kohle, Nuklearenergie, Produktion von Einwegplastik, Nicht-Ratifizierung der UN-Biodiversität, Nicht-Ratifizierung des Pariser Abkommens</p>	 <p><b>GESUNDHEITS SCREENING AUSSCHLUSS:</b> Genetisch verändertes Saatgut, Tabak, Zuckerproduzenten</p>	 <p><b>ETHISCHES SCREENING AUSSCHLUSS:</b> Erwachsenen-Unterhaltung, Nicht-Ratifizierung der nuklearen Nichtverbreitung, Unfreie oder korrupte Länder</p>	 <p><b>NORMBASIERTER AUSSCHLUSS:</b> Verletzung der UN Global Compact Prinzipien</p>
--	---	---	---

Zusätzlich werden folgende PAIs (Principal Adverse Impact) berücksichtigt:

- |  |  |
|--|--|
| <p>Nr. 1 „Treibhausgasemissionen“ (Scope 1, Scope 2, Scope 3)</p> <p>Nr. 2 „CO<sub>2</sub>-Fußabdruck“</p> <p>Nr. 3 „Treibhausgasintensität“</p> <p>Nr. 4 „Beteiligung an fossilen Brennstoff Unternehmen“</p> <p>Nr. 10 „Verletzungen der Prinzipien des UN Global Compact und der OECD Richtlinien für multinationale Unternehmen“</p> | <p>Nr. 14 „Exposure gegenüber kontroversen Waffen“ (Personenminen, Streumunition, chemische oder biologische Waffen)</p> <p>Zudem werden die Unternehmen auf Basis der Daten von Sustainalytics einer Kontroversen-Überprüfung unterzogen. Diese bewertet die Beteiligung von Unternehmen an Vorfällen mit negativen Auswirkungen auf Umwelt, Soziales und Governance (ESG).</p> |
|--|--|

## ANLAGESTRATEGIE

Der MainFirst Absolute Return Multi Asset verfolgt als global investierender Mischfonds das Ziel, eine langfristig positive Rendite oberhalb von 5 % bei vertretbarem Risiko zu erwirtschaften. Dabei bedient sich der Fonds einer breit diversifizierten Anlagestruktur von Aktien, Anleihen, Währungen und Rohstoffen auf globaler Ebene. Bis zu 50 % des Fondsvermögens kann in Aktien investiert werden. Die Titelauswahl erfolgt langfristig nach einem themenbasierten Ansatz, der sich auf strukturell wachsende Zukunftsthemen wie mobiles Internet, Industrie 4.0 und globale Marken konzentriert. Bei der Selektion und Allokation der Anlagen werden sowohl technische Indikatoren genutzt wie auch fundamentale Bottom-up- und Top-down-Researchs analysiert. Im Vordergrund steht dabei stets die Attraktivität des Chance-Risiko-Profiles. Gleichzeitig wird das absolute Verlustrisiko durch quantitative sowie qualitative Risikoanalysen kontinuierlich überwacht und gesteuert. Dabei kann die Aktien- und Währungsquote taktisch auch über Futures abgesichert werden.

## AUFTEILUNG DER INVESTITIONEN

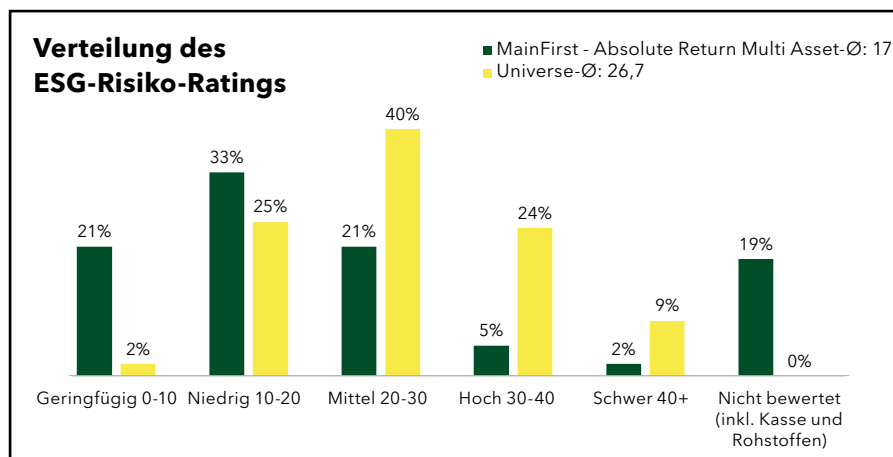
Das Produkt verfolgt nicht die Zielsetzung nur in nachhaltige Werte im Sinne der SFDR zu investieren. ESG-Faktoren werden bei jeder Investitionsentscheidung berücksichtigt.

## METHODEN

Die Nachhaltigkeitsratings des Ratinganbieters Sustainalytics erleichtern den Entscheidungsfindungsprozess durch eine tiefgreifende Einordnung der Investments nach nachhaltigkeitsbezogenen Faktoren wie Umwelt, Soziales und Governance. Die Einordnung des ESG-Risiko-Scores erfolgt dabei global und innerhalb des gesamten analysierten Universums. Der gewichtete Durchschnitt der ESG-Risiko-Scores der im Portfolio befindlichen Unternehmen wird mit dem gewichteten Durchschnitt-Score des Universums verglichen. Der MainFirst Absolute Return Multi Asset soll im Durchschnitt ein mittleres oder besseres ESG-Risiko-Profil aufzeigen. Für alle nicht von Sustainalytics abgedeckten Titel wird eine interne eigene ESG-Analyse erstellt.

## ÜBERWACHUNG DER ÖKOLOGISCHEN ODER SOZIALEN MERKMALE

Die Verteilung des ESG-Risiko-Scores wird täglich überwacht und regelmäßig publiziert.



Quelle: Sustainalytics, 30.12.2022

## DATENQUELLEN UND -VERARBEITUNG

Die primäre Datenquelle der ESG-Analyse ist Sustainalytics. Die benötigten Daten werden für die pre- und post-trade Compliance im Ordermanagementsystem hinterlegt.

## BESCHRÄNKUNGEN HINSICHTLICH DER METHODEN UND DATEN

Kleinere Unternehmen berichten bislang noch wenig zu ESG-bezogenen Risiken und daraufhin ergriffenen Maßnahmen, sodass die Datenlage dort schwieriger ist und die Gefahr besteht, dass kleinere Unternehmen im ESG-Rating von Sustainalytics schwächer abschneiden beziehungsweise kein ESG-Rating vorhanden ist. Oftmals liegen nur wenig Daten vor, um eigene ESG-Analysen anzufertigen.

## SORGFALTPFLICHT

Die interne Prüfung der Kriterien und Prozesse erfolgt durch Portfolio Management, Investment Compliance & Risiko Management. Die externe Überprüfung der zur Verfügung gestellten Indikatoren und Scores erfolgt mittels Sustainalytics. Zusätzlich wurden unsere Prozesse durch FNG extern überprüft.

## MITWIRKUNGSPOLITIK

Der Engagement-Prozess basiert auf den folgenden drei Säulen:

1. direkter Dialog,
2. formeller Engagement-Prozess,
3. gesellschaftliches Engagement.

siehe

- [ESG Policy](#)
- [Voting Policy](#)
- [Verkaufsprospekt](#)

### Disclaimer

Gegenstand dieses Dokuments sind ESG-Informationen für den Anleger über diesen Fonds. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen die Wesensart dieses Fonds und die Risiken einer Anlage im Kontext zu ESG zu erläutern. Wir raten Ihnen zur Lektüre dieses Dokuments, so dass Sie eine fundierte Anlageentscheidung treffen können. Weitere Informationen zu dem Teilfonds, der aktuell gültige Verkaufsprospekt nebst Anhang und Satzung sowie die letztgültigen Jahres- und Halbjahresberichte jeweils in deutscher, englischer und französischer Sprache können zu den üblichen Geschäftszeiten kostenlos bei der Investmentgesellschaft, Verwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle sowie der/n Vertriebsstelle(n) und der/n Zahlstelle(n) angefordert werden.

Ein Teilfonds der MainFirst (Société d'Investissement à Capital Variable). Der Fonds wird von der MainFirst Affiliated Fund Managers S.A. (Société Anonyme) verwaltet. Weitere Informationen zum Fonds entnehmen Sie bitte unserer Website ([www.mainfirst.com](http://www.mainfirst.com)).

Stand: 01.01.2023