

Produktbezogene Offenlegungspflichten gemäß Artikel 10 DiscI VO (Transparenz-Verordnung EU 2019/2088) für den La Française Systematic Multi Asset Allocation

Ökologische und soziale Merkmale des Sondervermögens

Der La Française Systematic Multi Asset Allocation ist ein global investierender Mischfonds. Er erwirbt überwiegend richtlinienkonforme Investmentanteile, darunter auch ETFs und Aktien. Im Vordergrund der gehaltenen Finanzinstrumente steht die Auswahl der Einzeltitel unter Berücksichtigung der Nachhaltigkeitskriterien. Unter Nachhaltigkeit versteht man ökologische (Environment – E) und soziale (Social – S) Kriterien sowie gute Unternehmens- und Staatsführung (Governance – G).

Das Vermögen des Fonds wird in Unternehmen investiert, die systematisch nach ökologischen, sozialen oder die verantwortungsvolle Unternehmensführung betreffenden Kriterien (ESG-Kriterien) handeln. Hierbei werden beispielsweise die Aspekte Umwelt- und Klimaschutz, Menschenrechte, Sicherheit und Gesundheit, Berichterstattung sowie Bekämpfung von Bestechung und Korruption beachtet. Darüber hinaus berücksichtigt das Sondervermögen im Anlageprozess den CO₂ Ausstoß der Unternehmen.

Angewandte Methoden zur Messung, Bewertung und Überwachung der ökologischen und sozialen Merkmale

Für den La Française Systematic Multi Asset Allocation findet eine diskretionäre Aktienauswahl bei aktivem Management statt, indem das eigene proprietäre Regelwerk zur Aktienselektion angewandt wird. Die Selektion erfolgt nach einem rein systematischen, prognosefreien Punktesystem auf Basis von Rangfolgen, wobei auch Nachhaltigkeitskriterien und gute Unternehmensführung berücksichtigt werden.

Um die Nachhaltigkeit zu bewerten, wird im ersten Schritt eine Nachhaltigkeitsziffer berechnet, der sog. ESG Score. Der ESG Score wird vom Research-Center der La Française Gruppe berechnet und zur Verfügung gestellt. Aus dem Anlageuniversum werden die besten 80% der Unternehmen nach ESG-Score ausgewählt. Im nächsten Schritt werden die Aktien, welche nicht über ein ausreichendes Handelsvolumen an den Börsen verfügen, aus dem investierbaren Universum ausgeschlossen.

Aus dem reduzierten Anlageuniversum wählt das Fondsmanagement der La Française Systematic Asset Management GmbH die Aktien

mittels ihres Multi-Faktormodells aus, die gleichgewichtet in den Fonds gekauft werden. Das Multi-Faktormodell besteht aus den Faktoren Quality, Value, Momentum, low Risk und low Carbon. Durch den low Carbon Faktor erhalten die Unternehmen einen hohen Score, welche über einen geringen CO₂-Ausstoß verfügen. Der Auswahlprozess wird regelmäßig wiederholt.

Die La Française Gruppe stellt das eigene Research-Center mit Sitz in London und Paris in den Mittelpunkt des Sustainable-Investment-Ansatzes, um passende Lösungen, die Berechnung des CO₂-Fußabdrucks sowie maßgeschneiderte CO₂-Kompensationen anzubieten. CO₂-Daten werden vom Carbon Disclosure Project (CDP) bereitgestellt. Geschätzte CO₂-Emissionen von Unternehmen nach Branchen werden mit einem proprietären Modell berechnet. Das Modell berücksichtigt folgende Kriterien eines Unternehmens: Sektorallokation, Umsätze, Anzahl der Mitarbeiter und Energieverbrauch.

Die Messung der CO₂-Intensität erfolgt zuerst auf Eben der Einzeltitel. Somit werden die CO₂-Emissionen des Portfolios durch die Unternehmensauswahl innerhalb der CO₂-intensiven Branchen gesteuert. Der CO₂-Ausstoß des Portfolios wird regelmäßig gemessen und mit einem Benchmark-Index verglichen. Das Ziel ist es, den CO₂-Fußabdruck des Portfolios im Vergleich zum Investmentuniversum signifikant zu reduzieren.

Das Fondsmanagement orientiert sich bei der Auswahl der richtlinienkonformen Investmentanteile an Nachhaltigkeitskriterien, die ausgewählten Investmentanteile sollen nach Möglichkeit unter Artikel 8 oder Artikel 9 der europäischen ESG-Offenlegungsverordnung klassifiziert sein.

Die Anlagestrategie wird dauerhaft überwacht und bei Bedarf angepasst, um u.a. die Nachhaltigkeitsziele zu erfüllen.

Darüber hinaus legt die Gesellschaft die Prinzipien für verantwortliches Investieren (UN Principles for Responsible Investment, „PRI“) zugrunde.