



Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungen für das Produkt „Multi Asset Nachhaltigkeit“ gemäß Artikel 10 Offenlegungsverordnung

Beschreibung der ESG-Anlagestrategie [Artikel 10 (1) a) Offenlegungs-VO]

Die von der Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG angebotene Multi Asset VV Nachhaltigkeit (MAVV Nachhaltigkeit) bewirbt ökologische und soziale Merkmale im Sinne des Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 („Offenlegungs-VO“).

Ziel dieses fondsbasierten Produktes ist es, eine Outperformance gegenüber dem Vergleichsmarkt zu erwirtschaften und dies mit einem deutlich höherem Nachhaltigkeits-Rating in Relation zum Vergleichsmarkt.

Die Selektion der Fonds innerhalb der einzelnen Marktsegmente folgt einem ganzheitlichen Portfolioansatz und wird anhand eines regelbasierten, systematischen Prozesses durchgeführt.

Dabei wird jeder Fonds einer Nachhaltigkeitsanalyse unterzogen, die folgende Elemente enthält:

- Quantitativer Stresstest
- Qualitatives Assessment des Investmentprozesses insbesondere hinsichtlich des ESG-Verständnisses und der ESG-Integration
- Verwendete Ausschlusskriterien

Die abschließende Einstufung eines Investments als „nachhaltig“ bemisst sich nach den Nachhaltigkeitskriterien beziehungsweise der Methodologie von MSCI Research (Nachhaltigkeits-Rating).

Aus Nachhaltigkeitsgesichtspunkten wird nur dann in einen Fonds investiert, wenn dieser ein relativ zum Vergleichsmarkt gleiches beziehungsweise besseres Nachhaltigkeits-Rating aufweist. Das Mindestrating, das ein Fonds aufweisen muss, ist abhängig von der jeweiligen Assetklasse beziehungsweise dem Marktsegment.

Darüber hinaus werden Fonds präferiert, die Unternehmen aus Bereichen, die in zivile Schusswaffen, kontroverse Waffen, Atomwaffen, Ölsand, thermische Kohle oder Tabak investieren, weitestgehend ausschließen.

Ein weiteres Ausschlusskriterium ist die Verletzung der UN Global Compact-Prinzipien.

Angaben zu den Methoden zur Bewertung, Messung und Überwachung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale [Artikel 10 (1) b) Offenlegungs-VO]

Im Rahmen der Anlagegrundsätze werden Nachhaltigkeitsanalysen von MSCI Research verwendet. Dabei werden Fonds selektiert, die den definierten Nachhaltigkeitsfilterkriterien entsprechen. Neben umfangreichen Ausschlusskriterien (Negativkriterien) findet ein Best-in-Class Ansatz Anwendung.

Die Berücksichtigung der Ausschlusskriterien erfolgt auf Basis der von den Fondsgesellschaften bereitgestellten Informationen sowie dem MSCI „Social Safeguard Screens“.

Im Best-in-Class Ansatz werden marktsegmentspezifische Mindest-Nachhaltigkeitsratings definiert, die ein Fonds erreichen muss, um zu den Besten eines Marktsegments zu gehören.