

## Angaben zu Art. 3 Abs.1 OffVO

### Transparenz bei den Strategien für den Umgang mit Nachhaltigkeitsrisiken

Nachhaltigkeitsrisiken sind Ereignisse oder Bedingungen aus den Bereichen Umwelt, Soziales oder Unternehmensführung, deren Eintreten tatsächlich oder potenziell wesentliche negative Auswirkungen auf den Wert der Investition des Fonds haben könnten.

Nachhaltigkeitsrisiken sind Bestandteil der bereits bekannten Risikoarten wie beispielsweise Marktrisiko, Liquiditätsrisiko, Kontrahentenrisiko und operationelles Risiko und können die Wesentlichkeit dieser Risiken beeinflussen.

#### **I. Investitionsentscheidungen**

Investitionsentscheidungen erfolgen bei Quoniam Asset Management GmbH ([Quoniam](#)) nach einem strukturierten aktiven Investmentprozess. Dabei ist auch das Prinzip der ESG Integration bei allen Investitionsentscheidungen verankert. Unter ESG Integration versteht man die systematische Berücksichtigung von Nachhaltigkeitsfaktoren in den wesentlichen Schritten des Investmentprozesses. Nachhaltigkeitsfaktoren sind dabei unter anderem Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte und die Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Die Integration von Nachhaltigkeitsfaktoren in den aktiven quantitativen Investmentprozess wird bei Quoniam grundsätzlich über ein Socially Responsible Investing Committee (SRI Committee) sichergestellt. Es behandelt unter anderem spezielle Unternehmen, Sektoren und Länder, die aufgrund konkreter Geschehnisse und/oder struktureller Trends unter Nachhaltigkeitsaspekten für Risiko-, Ertrags- und Bewertungsüberlegungen von besonderer Relevanz sind. Das Committee gibt bindende Investmentssignale und Empfehlungen mit Relevanz für alle betroffenen Assetklassen und an alle Portfoliomanager.

#### **II. Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken in Investitionsentscheidungen**

Im Rahmen von Quoniams Investmentprozess werden fundamentale Informationen über Unternehmen und Märkte, darunter auch eine Vielzahl von Nachhaltigkeitsfaktoren, mittels quantitativer Methoden verarbeitet.

Bei der Zusammenstellung der Portfolios können Quoniams Portfoliomanager jederzeit die Nachhaltigkeitsrisiken auf Einzeltitelebene wie auch für das gesamte Portfolio einsehen, messen und entsprechende Investitionsentscheidungen vornehmen. Auf diese Weise entstehen aktiv verwaltete, risikokontrollierte Portfolios, bei denen auch relevante Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt werden.

Um Nachhaltigkeitsrisiken zu verringern, macht Quoniam als aktiver quantitativer Asset Manager über verschiedene Initiativen auf Nachhaltigkeitsthemen aufmerksam, mit dem Ziel aktiv Einfluss auf Emittenten in Bezug auf Chancen und Risiken zu nehmen, die in Verbindung mit Nachhaltigkeitsfaktoren stehen können.

#### **III. Auswirkungen auf die Rendite**

Die Berücksichtigung von Nachhaltigkeitsfaktoren kann langfristig einen wesentlichen Einfluss auf die Wertentwicklung einer Investition haben. Emittenten mit mangelhaften Nachhaltigkeitsstandards können anfälliger für Ereignis-, Reputations-, Regulierungs-, Klage- und Technologierisiken sein. Diese Risiken im Bereich Nachhaltigkeit können unter anderem Auswirkungen auf das operative Geschäft, auf den Marken- bzw. Unternehmenswert und auf das Fortbestehen der Unternehmung haben. Das Eintreten dieser Risiken kann zu einer negativen Bewertung der Investition führen, die wiederum Auswirkungen auf die Rendite des Fonds haben kann.