

C-QUADRAT ARTS Total Return ESG

AT0000618137, AT0000A218K9, AT0000A2RXC8, AT0000A2RXB0

| | |
|-----------------------|--|
| Issuer | Ampega Investment GmbH |
| Fund provider | Ampega Investment GmbH |
| Fund type/Asset class | Equity fund |
| Legal form | UCITS |
| Fund issue date | 01/02/2021 |
| Last Update | 13.06.2024 |
| Benchmark | keine Benchmark |
| Tranche | Private Investors Institutional Investors |



Risk Indicator (PRIIP)
4 of 7

Licensed in
D, A

Classification by SFDR
Article 8

EU Taxonomy
-

% of Sustainable Investments according to SFDR
-

Principal Adverse Impacts



Sustainable Development Goals



NORMAL ALLOCATION

| | |
|----------------------------|--------------------------------|
| Equities | 0 % to 100 % |
| Bonds | 0 % to 100 % |
| Money market/Bank deposits | 0 % to 100 % |
| Commodities | Excluded |
| Direct investments | Excluded |
| Derivatives | 0 % to 49 % (for hedging only) |
| Other | - |

Sustainability approach

| | |
|---|--|
| Principal Adverse Impacts | <ul style="list-style-type: none"> ✓ Greenhouse Gas Emissions ✓ Water ✓ Waste ✓ Biodiversity ✓ Energy Efficiency and Fossil Fuels ✓ Social and Employee Matters |
| Further remarks on the consideration of SDGs | - |
| Rationale behind classification according to SFDR | <p>Article 8</p> <p>Der C-QUADRAT ARTS Total Return ESG ist ein Finanzprodukt, mit dem ökologische und soziale Merkmale im Rahmen der Anlagestrategie beworben werden und qualifiziert sich gemäß Artikel 8 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.</p> |
| Engagement | No |
| Voting | <p>Yes, organized externally</p> <p>Link to voting policy</p> |
| Best-in/of-Class | <p>Best-In-Class</p> <p>Seitens ISS ESG wird das Grunduniversum bestehend aus allen benötigten „Rohdaten“ zur Verfügung gestellt. Diese Daten umfassen Nachhaltigkeitsratings aller Unternehmen, sogenannte „ESG Corporate Ratings“ sowie auch einen Performance Score und Stammdaten wie Namen, ISIN, Industrie-Gruppe (Branche) und mehr. Aktuell werden für mehr als 7.500 Emittenten „Nachhaltigkeits-Ratings“ erstellt, die laufend überprüft und auf monatlicher Basis in Form von Masterfiles zur Verfügung gestellt werden. Diese Masterfiles, welche das kontroverse Screening nach FNG und nach den Richtlinien des UZ49 beinhalten, werden in weiterer Folge von ARTS automatisiert verarbeitet und in eine Datenstruktur eingespielt. Danach wird der relative Best-In-Class Ansatz wie folgt definiert: 1. Das Universum wird nach ESG-Rating und ESG-Performance-Score sortiert, hier gilt je höher desto besser 2. Danach wird nach Industrie (Branche) gruppiert 3. Innerhalb jeder Industrie-Gruppe wird jedem Emittenten ein Rang (Branchen-Ranking) zugewiesen (je höher desto besser) 4. Better-Than-Average - Aus dem Anlageuniversum sollen somit diejenigen Unternehmen und Staaten ausgewählt werden, die überdurchschnittliche Nachhaltigkeitsleistungen erbringen. Nach diesem Prinzip werden die Unternehmen innerhalb einer Branche sowie die Staaten direkt miteinander verglichen und auf ihre Nachhaltigkeit überprüft. Dadurch werden jene bevorzugt, die die Nachhaltigkeitskriterien Environmental, Social and Governance („ESG“) jeweils überdurchschnittlich erfüllen, also besser als der Durchschnitt („Better-Than-Average“) sind. Somit werden nur diejenigen Unternehmen innerhalb einer Branche zugelassen, deren Ranking größer (und damit besser) als das Median-Ranking ist, die restlichen Unternehmen werden ausgefiltert. Das Median-Ranking wird dabei stets konservativ auf die nächste Ganzzahl aufgerundet. Spezialfälle, wenn zwei Emittenten mit identem Rating und Score im Median liegen, werden somit ebenfalls ausgesondert und fallen aus dem Universum. Dadurch wird gewährleistet, dass zu jedem Zeitpunkt mindestens 50% an Unternehmen einer Industrie (Branche) ausgesondert werden. 5. Das finale Universum umfasst schlussendlich mehr als 3.200 Unternehmen, aus welchem das ARTS-Handelssystem die jeweils potenziell trendstärksten Kandidaten selektiert und nach entsprechendem Prüfprozess in das Portfolio aufnimmt. Darüber hinaus stehen auch Renten-Emissionen von Nationen (Sovereigns) zur Verfügung. Auch diese werden nach obigem Prozess gefiltert, wobei rund 25 Staaten, deren Emissionen den Anforderungen genügen, im Anlageuniversum für mögliche Investitionen verbleiben. Nach Finalisierung des Universums, wird dieses datenbankseitig archiviert und ist damit auch historisch dokumentiert und damit auch zu späteren Zeitpunkten transparent und nachvollziehbar.</p> |
| ESG-Integration | <p>Yes</p> <p>Der Fonds hält eine Mindestquote von 1 % des Wertes des Fonds in nachhaltigen Investments gemäß Art. 2 Nr. 17 der Offenlegungsverordnung. Nachhaltige Investitionen gemäß Art. 2 Nr. 17 der Offenlegungsverordnung sind Investitionen in wirtschaftliche Tätigkeiten, die zur Erreichung eines Umwelt- oder Sozialziels beitragen dabei kein anderes dieser Ziele erheblich beeinträchtigen und zudem die investierbaren Unternehmen die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden. Nachhaltige Investitionen werden als Beitrag zu den 17 Nachhaltigkeitszielen der Vereinten Nationen (Sustainable Development Goals, „SDGs“) klassifiziert.</p> |
| Norm-based screening | <ul style="list-style-type: none"> ✓ UN Global Compact ✓ ILO core labour standards ✓ OECD Guidelines for Multinational Enterprises |
| Themes | <ul style="list-style-type: none"> ✓ SDGs <p>SDGs werden über den SDG Solutions Score - Overall Score von ISS ESG berücksichtigt => Der Fonds hat eine Mindestquote von 1% in nachhaltigen Investments gemäß Art. 2 Nr. 17 der Offenlegungsverordnung festgelegt (lt. VKP).</p> |
| Impact Investing | - |
| Further information on the sustainability approach | <p>Der Fonds verfolgt eine aktive Managementstrategie und orientiert sich an keiner Benchmark. Es wird vielmehr angestrebt, auf langfristige Sicht gesehen einen absoluten Wertzuwachs nach ethisch-nachhaltigen Veranlagungskriterien zu erwirtschaften. Der Investmentprozess erfolgt anhand eines quantitativen Handelsansatzes in Übereinstimmung mit den jeweiligen Bestimmungen des Investmentfonds und gleichzeitig adäquater Berücksichtigung von Nachhaltigkeitsfaktoren. ARTS Asset Management als Spezialist für quantitative Handelssysteme, arbeitet im Nachhaltigkeitsbereich mit dem renommierten Analysehaus ISS ESG zusammen, welches das Nachhaltigkeitsresearch übernimmt und der ARTS-Strategie das Veranlagungsuniversum zur Verfügung stellt. Bei der Portfolioallokation werden ausschließlich Titel aus diesem vorselektierten Universum, sprich Werte die zum Zeitpunkt des Einsatzes im Einklang mit den Auflagen des österreichischen Umweltzeichens (kurz UZ49) als auch des FNG-Siegels stehen, eingesetzt. Dadurch soll der Fonds Unternehmungen sowie Staaten unterstützen, die verantwortungsvoll mit Umwelt-, Sozialen, und Governance-Themen umgehen. Gleichermäßen versucht das trendfolgende Handelssystem langfristig positive Erträge zu generieren und durch aktives Risikomanagement seine Investoren vor großen Kursrückschlägen zu bewahren. Investiert wird in die jeweils trendstärksten Unternehmen aus verschiedenen nachhaltigen Branchen und Regionen. Das professionelle Total Return Konzept sorgt für ein systematisches Risikomanagement und kann in einer positiven Aktienmarktphase mit einer Quote bis zu 100 Prozent am Aktienmarkt partizipieren. Um in negativen Börsenzeiten das Risiko zu begrenzen, können Aktien reduziert und das (Netto)-Aktienrisiko über Derivate bis auf 0 Prozent abgesichert bzw. in weniger risikoreiche Renten-Emissionen von Staaten, die als nachhaltig im Sinne des UZ49 und des FNG-Siegels eingestuft werden oder geldmarktnahe Anlagen ausgewichen werden. Der Fonds wird dabei jedoch stets eine physische Mindestquote von 51% an Wertpapieren halten. Eine darunter liegende Netto-Aktienquote wird durch Absicherung („Hedging“) über derivative Finanzinstrumente erreicht. Dies kann aber auch bedeuten, dass der Anleger über einen längeren Zeitraum nicht an der Aktienertragskomponente partizipiert.</p> <p>Link to sustainability approach</p> |

Research and Transparency

| | |
|--|--|
| In-house sustainability analysis | Yes, 5 |
| Research partners | Yes ISS ESG |
| Percentage of portfolio with sustainability analysis | 100 % |
| Strategically important suppliers included | No |
| Sustainability advisory committee | No |
| Analysis of portfolio CO2 | No |
| Sustainability reporting | Yes https://www.arts.co.at/Funds/Fund/AT0000618137 |
| At least monthly portfolio publication | Yes Link to monthly portfolio publication |
| Certification/Label awarded by independent auditors | ✓ FNG Label ✓ Austrian Ecolabel |

Environmental

EXCLUSION OF SECTORS / AREAS OF BUSINESS – COMPANIES

| | |
|--|---|
| Fossil fuels (Coal, Oil and Gas) | Yes 5 % Turnover threshold |
| Nuclear power (operation and components) | Yes 5 % Turnover threshold |
| Green genetic engineering | Yes 5 % Turnover threshold |
| Chlorine and agrochemicals (biocides) | No |
| Other | Stammzellenforschung (Klonierungsverfahren im Humanbereich und humane Embryonenforschung) |

EXCLUSION OF BUSINESS PRACTICES – COMPANIES

| | |
|------------------------------------|-------------------|
| Environmentally damaging behaviour | Yes |
| Damage to biodiversity | Yes |
| Other | Fracking & Ölsand |

EXCLUSION CRITERIA – COUNTRIES

| | |
|--|--------------------------------------|
| Non-ratification of the Paris Climate Agreement | Yes |
| Non-ratification of the Protocol on Biosafety | No |
| Non-ratification of the UN Biodiversity Convention | Yes |
| Nuclear power by proportion of gross energy production | Yes |
| Other | Verstoß gegen Atomwaffensperrvertrag |

Social

EXCLUSION OF SECTORS / AREAS OF BUSINESS – COMPANIES

| | |
|--|-------------------------------|
| Weapons/Armaments | Yes 5 % Turnover threshold |
| Cluster bombs and anti-personnel mines | Yes |
| Weapons of mass destruction (ABC/CBRN) | Yes |
| Tobacco products | Yes 5 % Turnover threshold |
| Pornography | No |
| Spirits/Alcohol | No |
| Gambling | No |
| Other | Stammzellen Forschung |

EXCLUSION OF BUSINESS PRACTICES – COMPANIES

| | |
|---|-----|
| Labour rights (ILO core labour standards) | Yes |
| Exploitative child labour | Yes |
| Violation of human rights | Yes |
| Animal testing | No |
| Other | - |

EXCLUSION CRITERIA – COUNTRIES

| | |
|--|---|
| Labour rights | Yes |
| Violation of human rights | Yes |
| Military spending as a percentage of GDP | Yes |
| Death penalty, torture | Yes |
| Countries classified by Freedom House as not free | Yes |
| Violations of the Nuclear Non-Proliferation Treaty | Yes |
| Violations of other non-proliferation treaties | Yes |
| Other | Diskriminierung, Meinungsfreiheit, Versammlungsfreiheit, Pressefreiheit |

Governance

EXCLUSION OF BUSINESS PRACTICES – COMPANIES

| | |
|--|---|
| Corruption and bribery | Yes |
| Tax: planned avoidance & detected violations | No |
| Other | Waffen und Rüstung, Kernkraft inkl. Uranbergbau, Kohle (Bergbau& bedeuts.Verstromung, Facking & Ölsand, UN Global Compact |

EXCLUSION CRITERIA – COUNTRIES

| | |
|------------|--|
| Corruption | Yes |
| Other | Verstoß gegen Atomwaffensperrvertrag, Kinderarbeit, Todesstrafe, Klimaschutz, Versammlungsfreiheit |

Quelle: Unternehmensangaben. | Für die Angaben der Unternehmen kann keine Haftung übernommen werden. Die Angaben dienen nur zur Information und stellen keine Beratung oder Empfehlung dar. Bitte beachten Sie den Haftungsausschluss unter www.forum-ng.org/disclaimer. Das FNG-Nachhaltigkeitsprofil bietet nur einen ersten Überblick und ist kein Ersatz für eine eigenständige Analyse. Weiterführende Erläuterungen finden Sie unter www.forum-ng.org