

Mitteilung an die Anleger

**des Anlagefonds „FERI Sustainable Quality“**  
(ein vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts Art „Effektenfonds“)

In der Mitteilung vom 18. September 2024 wurden die Anleger informiert, dass die LLB Swiss Investment AG, Zürich, als Fondsleitung, mit Zustimmung der Basler Kantonalbank, Basel, als Depotbank, beabsichtigt, den Fondsvertrag des Anlagefonds, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, anzupassen. In der Mitteilung vom 18. September 2024 an die Anleger wurden die Anpassungen namentlich genannt. Die folgenden Änderungen ergeben sich gegenüber der Publikation vom 18. September 2024:

**Anlagepolitik (§ 8 Ziff. 2)**

Gegenüber der Mitteilung vom 18. September 2024 erfahren die nachfolgenden Abschnitte weitere Präzisierungen, die nachstehend kursiv und unterstrichen dargestellt sind:

Im Portfoliomanagement wird mit einer Kombination aus Ausschlüssen sowie einem Positive-screening-Ansatz von umweltbezogenen („E“ für „Environment“), sozialen und ethischen („S“ für „Social“) Kriterien, sowie Kriterien guter Unternehmensführung („G“ für „Governance“) - zusammen „ESG“ – eine nachhaltige Anlagestrategie verfolgt. Das Nachhaltigkeitsziel definiert sich durch Investitionen in Vermögenswerte, deren Wirtschaftstätigkeit keinen wesentlichen Schaden in den Bereichen Umwelt und Gesellschaft verursacht und die gleichzeitig eine verantwortungsvolle Unternehmensführung vorweisen.

Nach Abzug von Bankguthaben und Devisentermingeschäften müssen zu jeder Zeit mindestens 65% der Vermögenswerte des Fonds in als nachhaltige Investitionen geltende Vermögenswerte gemäss nachfolgendem Abschnitt investiert sein. Zur Bestimmung des Anteils werden Ausschlusskriterien angewendet und nach einem von FERI (Schweiz) AG eigens entwickelten SDG-Score ermittelt, der aus 5 Prüfschritten besteht. Nur wenn alle 5 Prüfschritte durchlaufen sind und die Investition alle Vorgaben, Kriterien und Schwellenwerte erfüllt hat, darf sie nach der FERI-Methodologie als „nachhaltige Investition“ bezeichnet werden.

Die verbleibenden Vermögenswerte (max. 35%) erfüllen mindestens die FERI-interne Nachhaltigkeits-Mindestrichtlinie, *die neben Ausschlüssen einen Best-in-Class Ansatz verfolgt* (Prüfschritt 1).

Alle im Fonds gehaltenen Vermögenswerte erfüllen jederzeit die Ausschlusskriterien von SVVK-ASIR.

Die Methodik besteht aus zwei Grundsäulen (Ausschlüsse und Positive-Screening-Ansatz), die zusammen das Ziel anstreben, Unternehmen auszuwählen, die im Einklang mit globalen Normen stehen, ein insgesamt geringes ESG-Risiko aufweisen (und/oder sich auf einem Verbesserungspfad befinden), und möglichst eine positive Ausrichtung auf die 17 UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung aufweisen.

Zunächst werden die Empfehlungen zum Ausschluss der SVVK-ASIR (Schweizer Verein für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen) berücksichtigt (Ausschlüsse). Damit werden Anlagen in Hersteller von kontroversen Waffen ausgeschlossen. Bei den ausgeschlossenen Unternehmen bzw. Emittenten aus dem Rüstungssektor handelt es sich um Firmen, deren Produkte gegen Schweizer Gesetze und international anerkannte Konventionen verstossen, namentlich die Ottawa- und Oslo-Konventionen sowie dem internationalen Atomwaffensperrvertrag. Diese von der Schweiz ratifizierten Abkommen verbieten Entwicklung, Herstellung, Lagerung und Vertrieb von Streumunition, Anti-Personenminen und Nuklearwaffen. Alle Unternehmen, deren Titel vom Fonds gehalten werden, unterliegen diesem Ausschlusskonzept. Weitere Informationen zur SVVK-ASIR sind auf deren Website <https://www.svvk-asir.ch/ueber-uns/> zu finden.

In einem zweiten Schritt bewertet der SDG-Score die nach den Ausschlüssen verbleibenden Gesellschaften mit dem Ziel diese als nachhaltig geltende Anlagen zu klassifizieren. Der Prüfprozess

ist grundsätzlich in zwei Ebenen unterteilt: eine Risikoprüfungs-Ebene und eine Wirkungsprüfungs-Ebene.

Innerhalb der Risikoprüfung werden neben der regulatorisch erforderlichen Schadensprüfung (DNSH-Test) auch FERI spezifische Mindestkriterien angewendet und eine umfangreiche proprietäre Bewertung der ESG-Profile der Investitionen durchgeführt (ESG-Score).

Die Wirkungsprüfung besteht aus zwei Faktorenmodellen, bei denen wirkungsbezogene Informationen der Zielinvestitionen von zwei unterschiedlichen Datenanbietern geprüft und angewendet werden.

Anteilsgewichtet errechnet sich dann der Gesamtanteil nachhaltiger Investitionen im Fonds, wobei jeweils die gesamte Investition in ein Unternehmen bzw. Emittent, welche als „Nachhaltige Investition“ qualifiziert, angerechnet wird.

Wird in Zielfonds investiert, die ausschliesslich "Ausschluss" oder "ESG-Integration" als Nachhaltigkeitsansatz anwenden, so qualifizieren diese nicht als Zielfonds mit Nachhaltigkeitsbezug. Zielfonds ohne Nachhaltigkeitsbezug werden der obigen 10% Limite bezüglich "Investitionen mit den geringsten Nachhaltigkeitskriterien") zugerechnet.

Zudem wird das nachfolgende Umweltziel (Klima-Ausrichtung) verfolgt. Nach Abzug von Bankguthaben und Devisentermingeschäfte müssen zu jedem Zeitpunkt mindestens 32,5% der Vermögenswerte des Fondsvermögens (anteilsgewichtet) in Unternehmen investiert sein, die gemäß der FERI-Methodologie zur Bestimmung "nachhaltiger Investitionen" als nachhaltig eingestuft sind und darüber hinaus über ein von der Science Based Targets Initiative verifiziertes Ziel verfügen, das mit dem Übereinkommen von Paris, dem "Pariser Klimaabkommen", vereinbar ist.

Im Prospekt ist eine umfassendere Beschreibung zu diesen angewandten ESG-Ansätzen zu finden.

### **Fondsprospekt**

Der Fondsprospekt wurde entsprechend angepasst und aktualisiert. Zudem wurden formelle und redaktionelle Änderungen vorgenommen, die die Interessen der Anleger nicht tangieren und daher in dieser Publikation nicht im Detail beschrieben werden.

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2ter i.V.m. Art. 35a Abs. 1 KKV werden die Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität der Änderungen der Fondsverträge durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf sämtliche in dieser Veröffentlichung aufgeführten Änderungen erstreckt.

Gegen die in dieser Nachpublikation aufgeführten zusätzlichen Änderungen des Fondsvertrages können die Anleger keine Einwendungen erheben. Die Anleger können unter Beachtung der Bestimmungen des Fondsvertrages die Auszahlung Ihrer Anteile in bar verlangen.

Die Änderungen im Wortlaut, die aktuelle Fassung des Prospekts mit integriertem Fondsvertrag, die Wesentlichen Informationen für Anlegerinnen und Anleger sowie die letzten Jahres- und Halbjahresberichte können kostenlos bei der Fondsleitung bezogen werden.

Zürich, 22. November 2024

**Die Fondsleitung:**  
LLB Swiss Investment AG, Zürich

**Die Depotbank:**  
Basler Kantonalbank, Basel