

# UBS US Total Yield Sustainable Equity Fund USD I-A3-acc

## Fonds Factsheet

UBS Equity Funds > UBS Country & Regional Funds > North America

### Fondsbeschreibung

- Dieser aktiv verwaltete Aktienfonds investiert in ausgewählte Unternehmen aus den USA, von denen ein über dem Markt liegender Gesamtertrag (Total Yield) erwartet wird. Der Gesamtertrag ist die Summe der Erträge von Dividendenzahlungen und von Firmengewinnen, die über Aktienrückkäufe an die Aktionäre zurückgegeben werden.
- Fokus auf Qualitätskriterien mit dem Ziel, Firmen mit geringer Qualität auszuschliessen.
- Das Portfolio ist gut diversifiziert mit geringen Einzeltitelgewichten und breiter Sektorverteilung.
- UBS Total Yield Equity Funds haben typische Aktienrisikomerkmale. Gesamtertrag (Total Yield) ist nicht mit Gesamtertragsrate (Total Return) zu verwechseln.

Weitere Informationen finden Sie auf der nächsten Seite. 4.

|                                       |  |
|---------------------------------------|--|
| Fondsname                             | <b>UBS (Lux) Equity SICAV - US Total Yield Sustainable (USD)</b>   |
| Anteilsklasse                         | UBS (Lux) Equity SICAV - US Total Yield Sustainable (USD) I-A3-acc |
| ISIN                                  | LU1297653567   |
| Valoren Nr.                           | 29 702 571   |
| Bloomberg                             | UBUTIA3 LX   |
| Währung des Fonds / der Anteilsklasse | USD/USD  |
| Lancierungsdatum                      | 14.10.2015   |
| Ausgabe/Rücknahme                     | täglich  |
| Swing Pricing                         | Ja   |
| Abschluss Rechnungsjahr               | 31. Mai  |
| Benchmark                             | MSCI USA (net div. reinv.)   |
| Ausschüttung                          | Thesaurierung  |
| Verwaltungsgebühr p.a.                | 0.420%   |
| Laufende Kosten p.a. <sup>1</sup>     | 0.54%  |
| Name der Verwaltungsgesellschaft      | UBS Asset Management (Europe) S.A., Luxembourg                     |
| Fondsdomizil                          | Luxemburg  |
| SFDR Classification                   | Art.8  |

<sup>1</sup> Per 20.09.2024, ohne Transaktionskosten

### Aktuelle Daten

|  |          |
|--|----------|
| Inventarwert (USD, 30.09.2024)           | 255.53   |
| Letzte 12 Monate (USD) – Höchst          | 255.53   |
| – Tiefst                                 | 193.56   |
| Gesamtfondsvermögen (USD in Mio.)        | 1 483.69 |
| Vermögen der Anteilsklasse (USD in Mio.) | 19.08    |

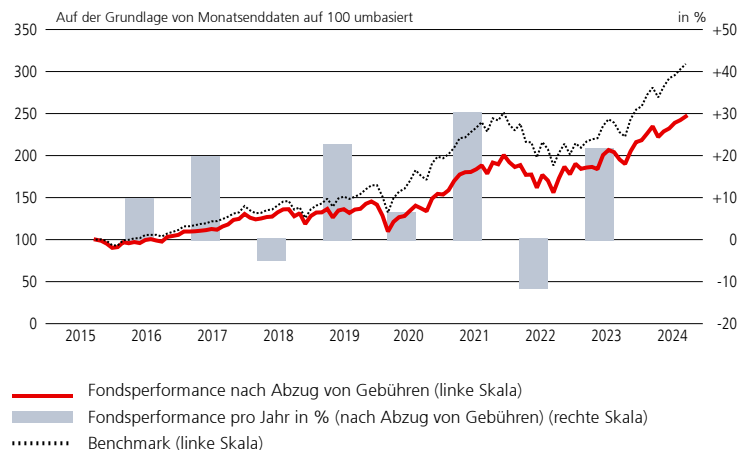
### Weitere Informationen

UBS Fund Infoline: 0800 899 899  
Internet: [www.ubs.com/fonds](http://www.ubs.com/fonds)  
Kontaktieren Sie Ihren Kundenberater

### Portfolio Management:

Jeremy Raccio  
Ian Paczek  
Jie Song

### Performance (Basis USD, nach Abzug von Gebühren)<sup>1</sup>



Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein zuverlässiger Indikator für zukünftige Ergebnisse.

| in %                   | 2021  | 2022   | 2023  | 2024  | Sep. 2024 | LTD <sup>3</sup> | Ø p.a. 3 Jahre | Ø p.a. 5 Jahre |
|------------------------|-------|--------|-------|-------|-----------|------------------|----------------|----------------|
| Fonds (USD)            | 29.97 | -11.43 | 21.53 | 14.15 | 1.83      | 155.53           | 11.38          | 12.68          |
| Benchmark <sup>4</sup> | 26.45 | -19.85 | 26.49 | 21.32 | 2.12      | 222.01           | 10.59          | 15.40          |

Die dargestellte Wertentwicklung berücksichtigt weder Kommissionen noch Ausgabe- oder Rücknahmeaufschläge.

<sup>1</sup> Diese Zahlenangaben beziehen sich auf die Vergangenheit. **Stimmt die Währung eines Finanzprodukts bzw. einer Finanzdienstleistung oder die Kosten nicht mit ihrer Referenzwährung überein, so kann sich die Rendite und/oder die Kosten aufgrund von Währungsschwankungen erhöhen oder verringern.** Quelle für sämtliche Daten und Grafiken (sofern nicht anders vermerkt): UBS Asset Management.

<sup>2</sup> YTD: year-to-date (seit Jahresbeginn)

<sup>3</sup> LTD: launch-to-date (seit Auflegung)

<sup>4</sup> Referenzindex in der Währung der Anteilsklasse (ohne Kosten)

Der Fonds wurde per 29. November 2021 neu positioniert und der Fondsname von UBS (Lux) Equity SICAV - US Total Yield (USD) in UBS (Lux) Equity SICAV - US Total Yield Sustainable (USD).

| in %        | 04.2024 | 05.2024 | 06.2024 | 07.2024 | 08.2024 | 09.2024 |
|-------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Fonds (USD) | -5.43   | 2.99    | 1.56    | 2.87    | 1.34    | 1.83    |
| Benchmark   | -4.15   | 4.73    | 3.54    | 1.23    | 2.37    | 2.12    |

### Kennzahlen

|                          | 2 Jahre | 3 Jahre | 5 Jahre |
|--------------------------|---------|---------|---------|
| Beta                     | 1.04    | 0.96    | 0.97    |
| Korrelation              | 0.94    | 0.96    | 0.96    |
| Volatilität <sup>1</sup> |         |         |         |
| – Portfolio              | 15.23%  | 17.73%  | 18.51%  |
| — Benchmark              | 13.84%  | 17.74%  | 18.37%  |
| Tracking Error (ex post) | 5.11%   | 4.99%   | 5.07%   |
| Information-Ratio        | -0.46%  | 0.16%   | -0.54%  |
| Sharpe Ratio             | 1.36    | 0.43    | 0.55    |
| Risikoloser Zinssatz     | 5.09%   | 3.70%   | 2.45%   |
| R2                       | 0.89    | 0.92    | 0.93    |

<sup>1</sup> Annualisierte Standardabweichung

# UBS US Total Yield Sustainable Equity Fund USD I-A3-acc

## Sektorengagement (%)

|                                | Fonds | Abweichung vom Index |
|--------------------------------|-------|----------------------|
| Informations Technologie       | 28.16 | -2.9                 |
| Nicht-Basiskonsumgüter         | 14.64 | +4.4                 |
| Finanzwesen                    | 13.32 | +0.6                 |
| Industrie                      | 10.84 | +2.0                 |
| Kommunikationsdienstleistungen | 9.64  | +0.7                 |
| Energie                        | 7.87  | +4.4                 |
| Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe  | 7.41  | +5.0                 |
| Gesundheitswesen               | 5.40  | -6.3                 |
| Basiskonsumgüter               | 2.72  | -3.1                 |
| Versorgungsbetriebe            | 0.00  | -2.5                 |
| Real Estate                    | 0.00  | -2.4                 |

## Vorteile

Einfacher Zugang zu Aktien aus den USA, welche hohe Gesamterträge offerieren (Gesamterträge ist die Summe von Dividenden und Aktienrückkäufen). Investoren können von einem Portfolio profitieren, welches eine optimale Diversifikation anstrebt - geringe Einzeltitelgewichte und breite Sektorverteilung. Erfahrenes Investment Team mit solidem Leistungsausweis in der Verwaltung von US Aktien- und Aktienertragsstrategien.

## Zusätzliche Informationen

- UBS Asset Management klassifiziert diesen Fonds als Sustainability Focus Fund, der im Einklang mit Artikel 8 der SFDR ökologische und soziale Merkmale bewirbt. Die Verfahren zur Analyse und zum Portfolioaufbau erstrecken sich auf die Integration und das Screening von ESG-Risiken und entsprechen der nachhaltigkeitsbezogenen Ausschlusspolitik von UBS Asset Management. Weitere Informationen über Nachhaltigkeit bei UBS erhalten Sie auf [www.ubs.com/am-si-commitment](http://www.ubs.com/am-si-commitment).
- Der Portfolio Manager ist bei der Auswahl und Gewichtung der Anlagen nicht an die Benchmark gebunden.

## 10 grösste Aktienpositionen (%) <sup>1</sup>

|                       | Fonds |
|-----------------------|-------|
| Apple Inc             | 8.8   |
| Visa Inc              | 2.8   |
| Mastercard Inc        | 2.7   |
| Netflix Inc           | 2.5   |
| McDonald's Corp       | 2.4   |
| Cisco Systems Inc     | 2.4   |
| Chevron Corp          | 2.4   |
| Caterpillar Inc       | 2.4   |
| Applied Materials Inc | 2.3   |
| PulteGroup Inc        | 2.3   |

<sup>1</sup> Dies stellt keine Empfehlung zum Kauf oder Verkauf von Wertpapieren dar.

## Risiken

Die UBS Country & Regional Funds investieren in Aktien und können daher grossen Wertschwankungen unterworfen sein. Da diese UBS Fonds einen aktiven Managementstil verfolgen, kann die Wertentwicklung der einzelnen Portefeuilles von jener des Referenzindex abweichen.

Jede Anlage ist Marktschwankungen unterworfen. Jeder Fonds hat spezifische Risiken, die sich unter ungewöhnlichen Marktbedingungen erheblich erhöhen können. Die ausschüttenden (-dist) Anteilsklassen dieses Subfonds beabsichtigen, sowohl Kapital als auch Erträge (z.B. von Dividenden) auszuschütten. Für Investoren in gewissen Ländern können auf ausgeschüttetem Kapital höhere Steuersätze anfallen als auf Kapitalgewinnen, welche bei der Veräusserung von Fondsanteilen realisiert werden. Gewisse Investoren mögen deshalb ein Investment in die reinvestierenden (-acc) statt in die ausschüttenden (-dist) Anteilsklassen wählen. Investoren können auf Erträgen und Kapital aus reinvestierenden (-acc) Anteilsklassen zu einem späteren Zeitpunkt besteuert werden im Vergleich zu ausschüttenden (-dist) Anteilsklassen. Anleger sollten diesbezüglich ihre eigene zertifizierte Steuerberatung einholen. Gesamtertrag (Total Yield) ist nicht mit Gesamtertragsrendite (Total Return) zu verwechseln. Dieser Fonds ist unter Umständen nicht für Anleger geeignet, die ihr Geld vor Ablauf der im PRIIPs KID angegebenen empfohlenen Haltedauer abziehen wollen, falls für diese Anteilsklasse verfügbar.

Jede Anlage ist Marktschwankungen unterworfen. Jeder Fonds hat spezifische Risiken, die sich unter ungewöhnlichen Marktbedingungen erheblich erhöhen können. Bitte wenden Sie sich an Ihren Kundenberater, um weitere Informationen zu den mit diesem Produkt verbundenen Anlagerisiken zu erhalten.

# UBS US Total Yield Sustainable Equity Fund USD I-A3-acc

Bitte beachten Sie, dass zusätzliche Gebühren (z.B. Ausgabeauf- oder Rücknahmeabschläge) in Rechnung gestellt werden können. Nähere Angaben erhalten Sie von Ihrem Finanzberater. Vor einer Anlage sollten Anlegerinnen und Anleger das Basisinformationsblatt, den Prospekt sowie alle relevanten lokalen Angebotsunterlagen lesen und sich umfassend über die Risiken informieren. Anleger erwerben Anteile oder Aktien eines Fonds und nicht an einem bestimmten Basiswert, wie z.B. eines Gebäudes oder von Aktien eines Unternehmens. Definitionen von Finanzbegriffen finden Sie im Glossar unter [www.ubs.com/am-glossary](http://www.ubs.com/am-glossary).

**Für Marketing- und Informationszwecke von UBS.** Nur für professionelle Kunden / qualifizierte Anleger. UBS Fonds nach luxemburgischem Recht. Vorkehrungen die für den Vertrieb der erwähnten Fondsanteile getroffen wurden, können auf Initiative der Verwaltungsgesellschaft des/der Fonds gekündigt werden. Investitionen in ein Produkt sollten nur nach gründlichem Studium des aktuellen Prospekts und des Basisinformationsblatts erfolgen. Bei jeder Anlageentscheidung sollten alle Merkmale oder Anlageziele des Fonds berücksichtigt werden, die im Prospekt oder ähnlichen rechtlichen Unterlagen beschrieben sind. Anleger erwerben Anteile oder Aktien eines Fonds und nicht an einem bestimmten Basiswert, wie z.B. eines Gebäudes oder von Aktien eines Unternehmens. Die im vorliegenden Dokument zusammengetragenen Informationen und erlangten Meinungen basieren auf vertrauenswürdigen Angaben aus verlässlichen Quellen, erheben jedoch keinen Anspruch auf Genauigkeit und Vollständigkeit hinsichtlich der im Dokument erwähnten Wertpapiere, Märkte und Entwicklungen. Mitglieder der UBS-Gruppe sind zu Positionen in den in diesem Dokument erwähnten Wertpapieren oder anderen Finanzinstrumenten sowie zu deren Kauf bzw. Verkauf berechtigt. Anteile der erwähnten UBS Fonds können in verschiedenen Gerichtsbarkeiten oder für gewisse Anlegergruppen für den Verkauf ungeeignet oder unzulässig sein und dürfen innerhalb der USA weder angeboten noch verkauft oder ausgeliefert werden. Die genannten Informationen sind weder als Angebot noch als Aufforderung zum Kauf bzw. Verkauf irgendwelcher Wertpapiere oder verwandter Finanzinstrumente zu verstehen. Die frühere Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für künftige Ergebnisse. Die berechnete Performance berücksichtigt alle Kosten auf Fondsebene (laufende Kosten). Die Ein- und Ausstiegskosten, die sich negativ auf die Performance auswirken würden, werden nicht berücksichtigt. Wenn sich die zu zahlenden Gesamtkosten ganz oder teilweise von Ihrer Referenzwährung abweichen, können die Kosten aufgrund von Währungs- und Wechselkursschwankungen steigen oder sinken. Kommissionen und Kosten wirken sich negativ auf den Betrag der Anlage und die erwarteten Rendite aus. Sollte die Währung eines Finanzprodukts oder einer Finanzdienstleistung nicht mit Ihrer Referenzwährung übereinstimmen, kann sich die Rendite aufgrund der Währungs- und Wechselkursschwankungen erhöhen oder verringern. Diese Informationen berücksichtigen weder die spezifischen oder künftigen Anlageziele noch die steuerliche oder finanzielle Lage oder die individuellen Bedürfnisse des einzelnen Empfängers. Die zukünftige Wertentwicklung unterliegt einer Besteuerung, die von der persönlichen Situation jedes Anlegers abhängig ist und sich in der Zukunft ändern kann. Die Angaben in diesem Dokument werden ohne jegliche Garantie oder Zusage zur Verfügung gestellt, dienen ausschliesslich zu Informationszwecken und sind lediglich zum persönlichen Gebrauch des Empfängers bestimmt. Das vorliegende Dokument darf ohne schriftliche Erlaubnis von UBS Asset Management Switzerland AG oder einer lokalen verbundenen Gesellschaft weder reproduziert noch weiterverteilt noch neu aufgelegt werden. Quelle für sämtliche Daten und Grafiken (sofern nicht anders vermerkt): UBS Asset Management. Das hier beschriebene Produkt entspricht Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor. Informationen zu nachhaltigkeitsrelevanten Aspekten gemäß dieser Verordnung finden Sie auf [www.ubs.com/funds](http://www.ubs.com/funds). Die Benchmark ist das geistige Eigentum des jeweiligen Indexanbieters. Der Fonds bzw. die Anteilsklasse wird vom Indexanbieter weder gesponsert noch unterstützt. Der Prospekt oder Prospektzusatz des Fonds enthält den vollständigen Haftungsausschluss. Dieses Dokument enthält «zukunftsgerichtete Aussagen», die unter anderem, aber nicht nur, auch Aussagen über unsere künftige Geschäftsentwicklung beinhalten. Während diese zukunftsgerichteten Aussagen unsere Einschätzung und unsere Geschäftserwartungen ausdrücken, können verschiedene Risiken, Unsicherheiten und andere wichtige Faktoren dazu führen, dass die tatsächlichen Entwicklungen und Resultate sich von unseren Erwartungen deutlich unterscheiden. **Schweiz:** Vertreter in der Schweiz für UBS Fonds ausländischen Rechts: UBS Fund Management (Switzerland) AG, Postfach, CH-4002 Basel. Zahlstelle: UBS Switzerland AG, Bahnhofstrasse 45, CH- 8001 Zürich. Prospekt, Basisinformationsblatt, Statuten bzw. Vertragsbedingungen sowie Jahres- und Halbjahresberichte der UBS Fonds können bei UBS Asset Management Switzerland AG, c/o UBS AG, Bahnhofstrasse 45, 8001 Zürich bzw. bei UBS Fund Management (Switzerland) AG, Postfach, CH-4002 Basel kostenlos in einer dem lokalen Recht entsprechenden Sprache angefordert werden. Eine Zusammenfassung der Anlegerrechte in englischer Sprache finden Sie online unter [www.ubs.com/funds](http://www.ubs.com/funds). Weitere Erläuterungen zu Finanzbegriffen unter [www.ubs.com/am-glossary](http://www.ubs.com/am-glossary).

© UBS 2024. Das Schlüsselsymbol und UBS gehören zu den geschützten Marken von UBS. Alle Rechte vorbehalten.

1000083541903888

# UBS US Total Yield Sustainable Equity Fund USD

## ESG-Bericht

**ESG** ist die Abkürzung für die Faktoren Environmental, Social and Governance (Umwelt, Soziales und Unternehmensführung). Anhand dieser Faktoren werden Unternehmen und Länder dahingehend beurteilt, welche Fortschritte sie im Hinblick auf Nachhaltigkeit bereits gemacht haben. Sobald genügend Daten zu diesen Faktoren vorliegen, können sie zur Bewertung und zum Vergleich von Vermögenswerten herangezogen werden. Zudem können sie bei der Entscheidung, welche Vermögenswerte gekauft, gehalten oder verkauft werden sollen, in den Anlageprozess einfließen.

### ESG-Performance

Der Fonds strebt danach, Unternehmen auszuwählen, die sich auf ökologische, soziale und / oder Governance-Themen konzentrieren. Die folgenden Abbildungen zeigen die Performance des Fonds in Bezug auf Nachhaltigkeitskriterien, die entweder ausdrücklich Teil der ESG-Ziele des Fonds sind oder in den Anlageprozess einbezogen werden.

#### Angewandte Nachhaltigkeitsansätze von UBS AM

- |  |   |   |
|--|---|---|
| <input checked="" type="checkbox"/> Ausschluss | <input checked="" type="checkbox"/> ESG-Integration     | <input checked="" type="checkbox"/> SI-Fokus            |
| <input type="checkbox"/> Impact                | <input checked="" type="checkbox"/> Stimmrechtsausübung | <input checked="" type="checkbox"/> Engagement-Programm |

Quelle: UBS Asset Management

#### ESG-Details der 10 grössten Aktienpositionen

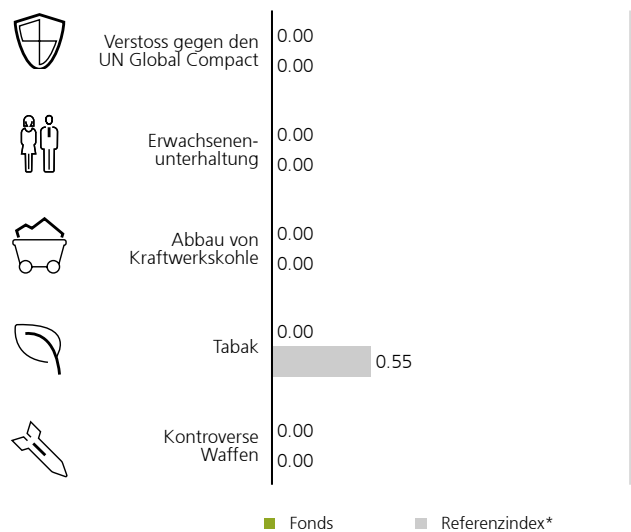
(in % des verwalteten Fondsvermögens)<sup>1</sup>

| Name der Position (Aktien) | Gewichtung | ESG Score |
|----------------------------|------------|-----------|
| Apple Inc                  | 8.8        | 6.5       |
| Visa Inc                   | 2.8        | 7.4       |
| Mastercard Inc             | 2.7        | 7.3       |
| Netflix Inc                | 2.5        | 5.4       |
| McDonald's Corp            | 2.4        | 6.4       |
| Cisco Systems Inc          | 2.4        | 7.3       |
| Chevron Corp               | 2.4        | 6.1       |
| Caterpillar Inc            | 2.4        | 5.6       |
| Applied Materials Inc      | 2.3        | 8.6       |
| PulteGroup Inc             | 2.3        | 5.8       |

<sup>1</sup> Dies stellt keine Empfehlung zum Kauf oder Verkauf von Wertpapieren dar.  
Quelle: UBS AG

#### Überprüfung auf kontroverse Geschäftstätigkeiten

(in % des verwalteten Fondsvermögens)<sup>1</sup>



<sup>1</sup> Der Fonds schliesst Emittenten aus, bei denen Verstösse gegen die Grundsätze des UN Global Compact erkannt wurden, die aber keine glaubwürdigen Korrekturmaassnahmen ergreifen

Quelle: MSCI ESG Research, UBS-AM exclusion policy (ISS Ethix and UNGC w/o credible corrective actions)

Referenzindex: MSCI USA (net div. reinv.)

# UBS US Total Yield Sustainable Equity Fund USD

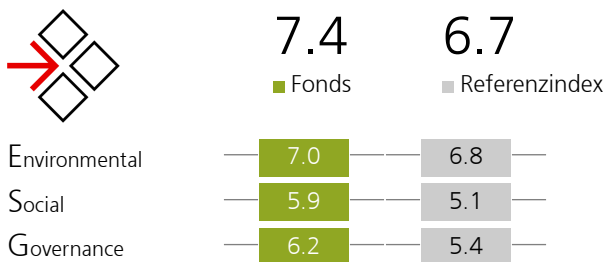
## ESG-Bericht

### ESG-Transparenz

Diese Seite bietet Transparenz über wichtige Nachhaltigkeitskennzahlen, die für Anleger von Interesse sein könnten, aber nicht Teil des Anlageprozesses des Fonds sind. Die folgenden Kennzahlen informieren Anleger allgemeiner über ihr Engagement in ausgewählten ESG-Themen.

#### MSCI ESG Scores, skaliert

(Gewichteter Durchschnitt des Engagements 0 bis 10)



Tatsächliche Datenabdeckung Fonds: 99.0%  
Reference index actual data coverage: 99.8%

Quelle: MSCI ESG Research  
Referenzindex: MSCI USA (net div. reinv.)

#### Externe Fondsratings<sup>1</sup>



1 Stand: 30.04.2024

Quelle: MSCI ESG Research, Morningstar

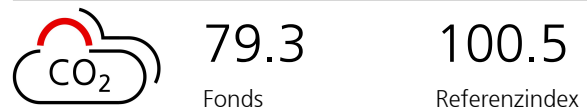
Morningstar Sustainability Rating™



Stand: 30.06.2024

#### Gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität, skaliert – Unternehmensemittenten

(tCO<sub>2</sub>- Äquivalent pro Mio. USD Umsatz)<sup>1</sup>



Tatsächliche Datenabdeckung Fonds: 100.0%  
Reference index actual data coverage: 99.8%

<sup>1</sup> Der Fonds hat eine niedrigere gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität (WACI) als der Referenzindex

Quelle: MSCI ESG Research  
Referenzindex: MSCI USA (net div. reinv.)

#### CO<sub>2</sub>-Fussabdruck, skaliert – Unternehmensemittenten

(tCO<sub>2</sub>-Äquivalent pro investierter Mio. USD)



Tatsächliche Datenabdeckung Fonds: 100.0%  
Tatsächliche Datenabdeckung Referenzindex: 99.7%

Quelle: MSCI ESG Research  
Referenzindex: MSCI USA (net div. reinv.)

### Glossar

**Kohlenstoff-Fussabdruck:** Drückt den Treibhausgas-Fussabdruck einer Anlagesumme aus. Die Kohlenstoffemissionen nach Scope 1 und 2 werden den Anlegern auf der Grundlage eines Unternehmenswertansatzes (unter Einbeziehung liquider Mittel) zugewiesen und mit dem aktuellen Fondswert normalisiert. Die CO<sub>2</sub>-Bilanz eines Fonds ist ein normalisiertes Mass für seinen Beitrag zum Klimawandel und ermöglicht den Vergleich mit einer Benchmark sowie zwischen einzelnen Fonds und Anlagen. Die Kennzahl drückt den gesamten CO<sub>2</sub>-Ausstoss in der Anlagewährung aus. Die Kennzahl wird auf 100% skaliert, wenn die tatsächliche Datenabdeckung über den definierten Schwellenwerten liegt – Festverzinsliche Wertpapiere: 50%; Aktien: 67%, Multi-Asset: 50%. Andernfalls wird die Kennzahl mit "-" angegeben. Klassifizierungssystem zur Trennung von Unternehmens- und staatlichen Emittenten: Bloomberg-Barclays-Methode. Verbriefte Anleihen sind von der Berechnung ausgeschlossen. «Kein Engagement» für den Fall, dass der Fonds in dem betreffenden Monat nicht in dem jeweiligen Emittenten investiert ist.

**Überprüfung auf kontroverse Geschäftstätigkeiten:** Engagement in kontroversen Geschäftstätigkeiten bezeichnet ein Engagement in Unternehmen, deren Umsatz in dem entsprechenden Geschäftsfeld (Produktion) eine bestimmte Schwelle überschreitet. Link zu unserer «Exclusion Policy» für

weitere Details (nur auf Englisch):  
-> [www.ubs.com/si-exclusion-policy](http://www.ubs.com/si-exclusion-policy)

**ESG Score (UBS Blended ESG Score\*):** Der UBS Blended ESG Score basiert auf UBS-internen und unabhängigen externen ESG-Datenquellen. Er ist branchenbereinigt und wird auf einer Skala von 0 (niedrigster / schlechtesten Score) bis 10 (höchster / bester Score) gemessen. Die Kennzahl wird auf 100% skaliert, wenn die tatsächliche Datenabdeckung über den definierten Schwellenwerten liegt – Festverzinsliche Wertpapiere: 50%; Aktien: 67%, Multi-Asset: 50%. Andernfalls wird die Kennzahl mit "-" angegeben. Klassifizierungssystem zur Trennung von Unternehmens- und staatlichen Emittenten: Bloomberg-Barclays-Methode. Verbriefte Anleihen sind von der Berechnung ausgeschlossen. «Kein Engagement» für den Fall, dass der Fonds in dem betreffenden Monat nicht in dem jeweiligen Emittenten investiert ist.

\*weitere Angaben finden Sie unter diesem [link](#)

**MSCI ESG-Scores** werden von MSCI ESG Research bereitgestellt und auf einer Skala von 0 (niedrigster / schlechtesten Score) bis 10 (höchster / bester Score) gemessen. Der individuelle MSCI E-, S- und G-Score gibt Aufschluss über die Widerstandsfähigkeit der Emittenten in Bezug auf ökologische, soziale oder die Unternehmensführung betreffende Risiken, die für die

# UBS US Total Yield Sustainable Equity Fund USD

## ESG-Bericht

Branche am wesentlichsten sind. Der aggregierte MSCI ESG-Score basiert auf diesen individuellen MSCI E-, S- und G-Scores, normalisiert sie aber relativ zu den Branchenwettbewerbern. Dies resultiert in einem gewichteten durchschnittlichen branchenbereinigten MSCI ESG-Score von branchenübergreifender Vergleichbarkeit. Die Kennzahl wird auf 100% skaliert, wenn die tatsächliche Datenabdeckung über den definierten Schwellenwerten liegt – Festverzinsliche Wertpapiere: 50%; Aktien: 67%, Multi-Asset: 50%. Andernfalls wird die Kennzahl mit "-" angegeben.

### **Angewandte Nachhaltigkeitsansätze von UBS AM**

**Ausschluss:** Strategien, anhand derer Wertpapiere aus Fonds ausgeschlossen werden, wenn sie nicht mit den Werten eines Anlegers im Einklang stehen. Beinhaltet massgeschneiderte Screening-Kriterien.

**ESG-Integration:** Strategien, die ESG-Faktoren in die fundamentale Finanzanalyse integrieren, um das Risiko-Rendite-Profil zu verbessern.

**SI-Fokus:** Strategien, bei denen Nachhaltigkeit einen expliziten Teil der Anlagerichtlinien, des Anlageuniversums sowie des Auswahl- und / oder Anlageprozesses bildet.

**Impact:** Strategien, bei denen neben finanziellen Erträgen auch ein messbarer ökologischer und / oder sozialer Nutzen («Impact») erzielt werden soll.

**Stimmrechtsausübung:** Das Voting Flag ist eine grundsatzbasierte Klassifizierung auf Produktebene (Top-down) und stützt sich auf die allgemeine Anwendbarkeit der Richtlinien von UBS AM. UBS übt Stimmrechte aktiv aus und orientiert sich dabei an den Grundsätzen, die in der UBS Asset Management Proxy Voting Policy und der UBS Asset Management Stewardship Policy erläutert werden. Dabei werden die folgenden grundlegende Ziele verfolgt: 1. Im besten finanziellen Interesse unserer Kundinnen Kunden zu handeln, um den Wert ihrer Anlagen langfristig zu steigern. 2. Vorbildliche Praktiken auf Führungsebene sowie nachhaltige Praktiken zu fördern. Dies ist indes kein Hinweis darauf, dass hinsichtlich der von einem Teilfonds gehaltenen Unternehmen in einem bestimmten Zeitraum über nachhaltigkeitsbezogene Themen abgestimmt wurde. Informationen zur Stimmrechtsausübung bei spezifischen Unternehmen (Bottom-up-Transparenz) finden Sie im jährlichen Stewardship-Bericht von UBS Asset Management. Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen können ferner von anderen Berichten abweichen, die sich zum Beispiel ausschliesslich auf klimabezogene Aktivitäten konzentrieren.

<https://www.ubs.com/global/en/assetmanagement/capabilities/sustainable-investing/stewardship-engagement.html>

**Engagement-Program:** Das Engagement-Programm zielt darauf ab, Unternehmen zu priorisieren/auszuwählen, bei denen UBS Asset Management bestimmte Vorbehalte hat oder bestimmte ESG-Themen aufgreifen möchte. Diese Unternehmen werden mit einem top-down Ansatz gemäß unseren Prinzipien, wie in der Global Stewardship Policy beschrieben, aus dem ganzen Universum der Unternehmen ausgewählt, in die UBS Asset Management investiert. Ein Priorisierungsprozess bestimmt, ob und wann ein Engagement mit einem Unternehmen notwendig ist. Falls ein Unternehmen für das Engagement-Programm ausgewählt wird, wird der Engagement Dialog für mindestens zwei Jahre ausgeübt.

Dies ist kein Hinweis darauf, dass in Bezug auf Unternehmen in diesem Portfolio in einem bestimmten Zeitraum ein Engagement zu bestimmten Vorbehalten von UBS Asset Management oder ESG-Themen stattgefunden hat oder dass

die Unternehmen in diesem Portfolio mit der Absicht ausgewählt wurden, sich aktiv zu engagieren. Informationen zu der Auswahl der Unternehmen, den Engagementaktivitäten, dem Priorisierungsprozess und dem Verständnis von Vorbehalten von UBS Asset Management sowie ESG-Themen können dem UBS Asset Management Stewardship Annual Report sowie der Stewardship Policy entnommen werden. Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen können ferner von anderen Berichten abweichen, die sich zum Beispiel ausschliesslich auf klimabezogene Aktivitäten konzentrieren.

<https://www.ubs.com/global/en/assetmanagement/capabilities/sustainable-investing/stewardship-engagement.html>

**Zusammenstellung der ESG- / Kohlenstoffdaten:** Die ESG-Scores der Fondsbestände und des Referenzindex werden anhand ihrer jeweiligen individuellen Gewichtungen und ESG-Scores (Summenprodukt) aggregiert.

**Dachfonds-Anlagen, Derivate und Barmittel:** Im Fonds genutzte Derivate und Dachfonds-Investments werden auf Look-through-Basis behandelt, das heisst, das wirtschaftliche Engagement im zugrunde liegenden Wertpapierkorb wird als tatsächliche Investition in die einzelnen Wertpapiere angesehen, aus denen dieser Korb besteht. Im Fall von Derivaten und Dachfonds auf Basis des breiten Marktes könnte dies zu minimalen Engagements in Wertpapieren führen, bei denen direkte Anlagen ausgeschlossen sind. Derivate wirken sich auf die Berechnungen von Kennzahlen aus. Da viele der Berichterstattungsrahmen, die Anlegerinnen und Anlegern derzeit zur Verfügung stehen, die Feinheiten von Derivaten ausser Acht lassen, werden entsprechende Kennzahlen auf Basis angemessener Bemühungen bereitgestellt.

Portfolios, für die wir die Nachhaltigkeitskennzahlen ausweisen, können Barmittel enthalten.

Die in diesem Bericht offengelegten Informationen, insbesondere was die Behandlung von Derivaten und Barmitteln betrifft, stimmen nicht unbedingt mit den Anlagemerkmalen des Fonds und der Art seiner Verwaltung überein. Daher können die Nachhaltigkeitskennzahlen in diesem Bericht von anderen UBS-Berichten abweichen, die zum gleichen Datum erstellt wurden.

**MSCI ESG Fondsratings** sollen die ESG-Eigenschaften der zugrunde liegenden Positionen eines Fonds messen, damit Anlagfonds und ETFs auf einer Ratingskala von AAA bis CCC eingestuft oder überwacht werden können.

### **Gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität – Unternehmensemittenten/Kohlenstoffintensität – Staatliche Emittenten:**

Diese Kennzahlen messen das Engagement eines Fonds in kohlenstoffintensiven Unternehmen und Staatsanleihen. Sie geben Aufschluss über potenzielle Risiken im Zusammenhang mit dem Übergang zu einer kohlenstoffärmeren Wirtschaft, da davon auszugehen ist, dass Unternehmen mit einer höheren Kohlenstoffintensität stärker mit kohlenstoffbezogenen Markt- und Regulierungsrisiken konfrontiert sind. Diese Kennzahlen sind auf alle Anlageklassen anwendbar. Es handelt sich um die Summe der Fondsgewichte und individuellen Kohlenstoffintensitäten (Kohlenstoffemissionen Scope 1+2 / Mio. USD Umsatz oder BIP). Die Kennzahl wird auf 100% skaliert, wenn die tatsächliche Datenabdeckung über den definierten Schwellenwerten liegt – Festverzinsliche Wertpapiere: 50%; Aktien: 67%, Multi-Asset: 50%. Andernfalls wird die Kennzahl mit "-" angegeben. Klassifizierungssystem zur



# UBS US Total Yield Sustainable Equity Fund USD

## ESG-Bericht

Trennung von Unternehmens- und staatlichen Emittenten: Bloomberg-Barclays-Methode. Verbriefte Anleihen sind von der Berechnung ausgeschlossen. «Kein Engagement» für den Fall, dass der Fonds in dem betreffenden Monat nicht in dem jeweiligen Emittenten investiert ist.

Das **Morningstar Sustainability Rating** unterstützt Anlegerinnen und Anleger bei der Beurteilung, wie Anlagefonds und ETFs die ESG-Herausforderungen (Umwelt, Soziales und Corporate Governance) angehen. Das Rating reicht von 1 bis 5 «Weltkugeln», wobei mehr Weltkugeln ein geringeres ESG-Risiko anzeigen. Die Anzahl der Weltkugeln,

die ein Fonds erhält, wird im Vergleich zu den anderen Fonds in der gleichen Morningstar Global Category bestimmt.

**Aktives ESG:** Die Auswahl der Benchmark wird durch Überlegungen hinsichtlich der Portfolioumsetzung bestimmt. Insbesondere geht es darum, den finanziellen Zielen des Fonds genau Rechnung zu tragen. Bei aktiv verwalteten Strategien wird in der Regel eine traditionelle Benchmark ausgewählt, um auf ein breites Anlageuniversum zugreifen zu können, auf das anschliessend das aktive Management angewandt wird.

### Wichtige Informationen über nachhaltige Anlagestrategien

Nachhaltige Anlagestrategien versuchen, die Faktoren Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) beim Anlageprozess und Fondsaufbau miteinzubeziehen. Strategien wenden ESG-Analysen regions- und stilübergreifend an und integrieren deren Ergebnisse auf vielfältige Weise. Die Einbeziehung von ESG-Faktoren oder Aspekten des nachhaltigen Investierens könnte die Fähigkeit von UBS beeinträchtigen, bestimmte Anlagechancen zu nutzen oder zu empfehlen, die andernfalls zu den Anlagezielen des Kunden oder der Kundin passen würden. Die Renditen eines Fonds, der sich in erster Linie aus nachhaltigen Anlagen zusammensetzt, können niedriger oder höher sein als bei Fonds, bei denen keine ESG-Faktoren, Ausschlüsse oder sonstige Nachhaltigkeitsthemen berücksichtigt werden, und die Anlageinstrumente, die solchen Fonds zur Verfügung stehen, können abweichen. Unternehmen, Emittenten von Produkten und / oder Hersteller erfüllen möglicherweise nicht bei allen Aspekten für ESG oder nachhaltiges Investieren hohe Performancestandards.

### Abstimmung des verwalteten Vermögens (AuM)

Dieser Bericht enthält keine abgestimmten AuM-Positionen, sondern berücksichtigt nur Positionen mit Abrechnungsdatum zum Berichtsstichtag. Das heisst, dass gehandelte – aber noch nicht abgerechnete Positionen – nicht berücksichtigt wurden. Daher können die AuM-Daten in diesem Bericht von anderen UBS-Berichten abweichen, die zum gleichen Datum erstellt wurden.

Obwohl die Informationsanbieter von UBS Asset Management, darunter MSCI ESG Research LLC und damit verbundene Unternehmen (die «ESG-Parteien») ihre Informationen aus Quellen beziehen, die sie als zuverlässig ansehen, übernimmt keine der ESG-Parteien eine Haftung oder Garantie für die Echtheit, Richtigkeit und/oder Vollständigkeit der hierin enthaltenen Daten. Die ESG-Parteien geben keine ausdrücklichen oder stillschweigenden Garantien jeglicher Art und lehnen ausdrücklich jegliche Gewährleistung für die Handelsüblichkeit oder Eignung der hierin enthaltenen Daten für einen bestimmten Zweck ab. Keine der ESG-Parteien kann für Fehler oder Unterlassungen im Zusammenhang mit den hierin enthaltenen Daten haftbar gemacht werden. Unbeschadet der vorstehenden Regelungen übernimmt keine der ESG-Parteien eine Haftung für direkte, indirekte, besondere, Straf-, Folge-, oder sonstige Schäden jeglicher Art (einschließlich entgangenen Gewinns), selbst wenn auf die Möglichkeit eines solchen Schadens hingewiesen wurde.

Bestimmte hierin enthaltene Informationen (die «Informationen») wurden bezogen von/unterliegen dem Urheberrecht von MSCI ESG Research LLC (ein registrierter Anlageberater (Registered Investment Adviser) im Sinne des US-amerikanischen Investment Advisers Act von 1940) oder damit verbundenen Unternehmen (einschliesslich MSCI Inc. und den Tochtergesellschaften («MSCI»)) oder von Drittanbietern (zusammen mit MSCI & MSCI ESG die «ESG-Parteien») und wurden möglicherweise zur Berechnung von Scores, Ratings oder anderer Indikatoren verwendet. Sie dürfen ohne schriftliche Genehmigung weder ganz noch teilweise reproduziert oder verbreitet werden. Die Informationen wurden nicht bei der US-amerikanischen Börsenaufsicht (SEC) oder einer anderen Aufsichtsbehörde eingereicht und auch nicht von dieser genehmigt. Die Informationen dürfen nicht zur Erstellung von oder in Verbindung mit abgeleiteten Werken verwendet werden und stellen auch weder ein Angebot zum Kauf oder Verkauf noch eine Bewerbung oder Empfehlung von Wertpapieren, Finanzinstrumenten oder -produkten oder Handelsstrategien dar und sollten auch nicht als Hinweis auf oder Garantie für eine zukünftige Performance, Analyse, Prognose oder Vorhersage angesehen werden. Einige Fonds können auf MSCI-Indizes basieren oder mit ihnen verbunden sein und MSCI kann im Rahmen von Verwaltungs- oder anderen Massnahmen auf Basis des Fondsvermögens eine Vergütung hierfür erhalten. MSCI hat Informationsbarrieren zwischen dem Aktienindex-Research und bestimmten Informationen errichtet. Keine der Informationen kann alleinstehend zur Bestimmung verwendet werden, welche Wertpapiere zu kaufen oder zu verkaufen sind oder wann sie zu kaufen oder zu verkaufen sind. Die Informationen werden im gegenwärtigen Zustand zur Verfügung gestellt und der Nutzer der Informationen trägt das volle Risiko für eine eventuelle Verwendung oder eine Entscheidung auf Grundlage dieser Informationen. Keine ESG-Partei gewährt oder garantiert die Echtheit, Richtigkeit und/oder Vollständigkeit der Informationen und alle ESG-Parteien lehnen ausdrücklich alle ausdrücklichen oder stillschweigenden Zusicherungen oder Gewährleistungen ab. Keine der ESG-Parteien übernimmt eine Haftung für Fehler oder Auslassungen in Bezug auf die Informationen oder eine Haftung für direkte, indirekte, besondere, Straf-, Folge-, oder sonstige Schäden jeglicher Art (einschliesslich entgangenen Gewinns), selbst wenn auf die Möglichkeit eines solchen Schadens hingewiesen wurde.