

## UBS (Lux) Equity SICAV - Engage for Impact (USD)

### Kein nachhaltiges Investitionsziel

Mit diesem Finanzprodukt werden ökologische oder soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen angestrebt. Der Portfolio Manager wendet Ausschlüsse auf das Anlageuniversum des Finanzprodukts an. Der Link zur Nachhaltigkeits-Ausschlusspolitik (Sustainability Exclusion Policy) ist im Hauptteil des Verkaufsprospektes zu finden.

Die Ausschlüsse umfassen unter anderem die Förderung von Kraftwerkskohle sowie die Energieerzeugung aus Kraftwerkskohle und Ölsanden. UBS Asset Management investiert nicht in Unternehmen, deren Tätigkeit mit umstrittenen Waffen in Zusammenhang steht, wie z. B. Streumunition, Antipersonenminen, chemische und biologische Waffen, oder in Unternehmen, die gegen den Atomwaffensperrvertrag (Treaty on the Non-Proliferation of Nuclear Weapons) verstossen.

Es wird überprüft, ob die Anlagen über die von dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verfügen (Positive Screening).

Der Portfolio Manager verwendet ein proprietäres ESG-Risiko-Dashboard, das Aktien- und Kreditanalysten die schnelle Ermittlung von Unternehmen mit wesentlichen ESG-Risiken anhand des «UBS ESG Risk Signal» ermöglicht. Dieses klare, messbare Signal dient als Ausgangspunkt für eine eingehendere Analyse der zugrunde liegenden Quellen für diese Risiken und ihrer Verbindung zu den betreffenden Anlagen.

Unternehmen, die gegen die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) verstossen und keine glaubhaften Korrekturmassnahmen vorweisen, werden aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

### Ökologische oder soziale Merkmale des Finanzprodukts

Mit dem Finanzprodukt werden die folgenden Merkmale beworben:

Eine 90-prozentige Überschneidung mit dem firmeneigenen Impact-Universum von Unternehmen, die an den Zielen für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen ausgerichtet sind. Das Produkt strebt Kapitalzuwachs und eine positive ökologische bzw. soziale Wirkung an. Dies erfolgt über Anlagen in und den Dialog mit attraktiv bewerteten Unternehmen, deren Produkte oder Dienstleistungen auf bestimmte UN-SDGs ausgerichtet sind und die Potenzial für weitere positive Wirkungen durch einen aktiven Dialog aufweisen.

Bei dem Referenzwert handelt es sich um einen breiten Marktindex, der ökologische und/oder soziale Merkmale weder berücksichtigt noch bewertet und daher mit den von dem Finanzprodukt beworbenen Merkmalen nicht im Einklang steht. Es wurde kein ESG-Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt.

Das Merkmal wird / die Merkmale werden jeweils anhand der folgenden Indikatoren gemessen:

Das firmeneigene Impact-Anlageuniversum besteht aus einzelnen Unternehmen, die z. B. eine Umsatzausrichtung auf bestimmte Impact-Kategorien aufweisen, wie etwa Klima, Gesundheit, Wasser, Ernährung und Gleichstellung, die mit den Zielen für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen (UN SDGs) verknüpft sind. Der Portfolio Manager kann auch Unternehmen einbeziehen, deren Wirkungspotenzial, gemessen an Kennzahlen wie den Ausgaben für Forschung und Entwicklung (F&E), auf die oben beschriebenen Impact-Kategorien ausgerichtet ist.

Der Portfolio Manager verwendet die UN-SDGs als Leitlinie und Rahmen für den Dialog mit den Portfoliounternehmen.

### Anlagestrategie

Das folgende verbindliche Element / Die folgenden verbindlichen Elemente der Anlagestrategie wird/werden für die Auswahl der Investitionen zur Erreichung der mit diesem Finanzprodukt beworbenen Merkmale verwendet:

Eine 90-prozentige Überschneidung mit dem firmeneigenen Impact-Universum von Unternehmen.

Barmittel, Derivate und Anlageinstrumente ohne Rating werden nicht in die Berechnung einbezogen.

Das verbindliche Element wird / Die verbindlichen Elemente werden zum Quartalsende anhand des Durchschnitts aus den Werten aller Geschäftstage im Quartal ermittelt.

### Aufteilung der Investitionen

Der Mindestanteil an Investitionen, die zur Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale getätigt werden, liegt bei 90%. Der Mindestanteil des Finanzprodukts an nachhaltigen Investitionen liegt bei 40%.

Derivate werden nicht zur Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen Merkmale genutzt. Der Einsatz von Derivaten erfolgt in erster Linie zu Absicherungs- und Liquiditätsmanagementzwecken.

### Überwachung der ökologischen oder sozialen Merkmale

Der Portfolio Manager verfügt über Datenindikatoren und eine systematische Kontrolle anhand von handelsvorbereitenden Richtlinien, um die von dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale, insbesondere die in der Anlagestrategie festgelegten verbindlichen Ziele, zu überwachen. Die Überwachung wird beaufsichtigt und kontrolliert. Ausserdem gibt es unabhängige Kontrollen und Prüfungen durch unsere beauftragten Fondsverwalter.

### Methoden

Die Leistungsfähigkeit der Indikatoren, die zur Messung der durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet werden, wird täglich gemessen, vierteljährlich bewertet und jährlich berichtet.

### Datenquellen und -verarbeitung

Zur Erreichung der angegebenen ökologischen oder sozialen Merkmale werden die folgenden Datenquellen verwendet:

Die Übereinstimmung der Umsätze mit den Zielen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) wird von einem führenden Datenanbieter geliefert.

Die Daten werden von führenden Anbietern bezogen, nach festgelegten Richtlinien aufbereitet und mit Empfehlungen von Analysten ergänzt.

#### **Beschränkungen hinsichtlich der Methoden und Daten**

Wir wenden einen Schwellenwert für die Mindestabdeckung der Datenquellen an, die zur Messung der Erreichung der angegebenen ökologischen oder sozialen Merkmale des Finanzprodukts verwendet werden. Diese Schwellenwerte stellen sicher, dass die verbindlichen Ziele überwacht und gemessen werden können. Die Genauigkeit der Daten hängt von Drittanbietern ab. Die Abdeckung durch die Datenquellen kann aufgrund von nicht erfassten Anlagearten, unvollständigen oder inkonsistenten Daten und Lücken in der Erfassung durch diese Drittanbieter weniger als 100% betragen.

#### **Sorgfaltspflicht**

Die UBS Group und UBS AM investieren erhebliche Ressourcen in ESG-Daten. Innerhalb von UBS AM werden die Datenauswahl und der Integrationsprozess gemeinsam von unserem Sustainable Investment Team und QED (Data Science) durchgeführt. So wird sichergestellt, dass die Datensätze aussagekräftige Erkenntnisse liefern und im Hinblick auf die Datenqualität solide sind. Die Auswahl und Integration der Daten sind nur ein Teil, da vor allem die Gewinnung von Erkenntnissen und deren tatsächliche Nutzung für Anlageentscheidungen zählt.

#### **Mitwirkungspolitik**

Im Rahmen unseres Research-Prozesses werden wir zudem versuchen, Unternehmen zu identifizieren, bei denen wesentliche ESG- und Nachhaltigkeitsfaktoren ein zukünftiges negatives Risiko darstellen könnten. Wir werden vorrangig mit diesen Unternehmen einen aktiven Dialog führen und zusätzlich die Stimmrechtsvertretung als Teil unserer Stewardship-Aktivitäten nutzen, um gegebenenfalls negative Auswirkungen zu minimieren. Wenn UBS AM direkte Eigentümerin eines physischen Vermögenswerts ist, richtet sie ihre Partner auf vorgeschriebene Standards und Leistungskennzahlen (KPIs) aus. Diese werden überwacht, damit Korrekturmaßnahmen ergriffen werden können, wenn Performanceziele und Standards nicht erfüllt werden.

#### **Bestimmter Referenzwert**

Nicht anwendbar.