



Summary document

Robeco Capital Growth Funds - Robeco QI Global Multi-Factor High Yield

Dieses Finanzprodukt fördert ökologische oder soziale Merkmale, hat aber nicht das Ziel einer nachhaltigen Anlage.

Das Produkt hat die folgenden E/S-Eigenschaften:

Der Teilfonds weist die folgenden ökologischen/sozialen Eigenschaften auf:

1. Der Teilfonds fördert bestimmte ökologische und soziale Mindestabsicherungsmaßnahmen durch Anwendung von Ausschlusskriterien im Hinblick auf Produkte und Geschäftspraktiken, die nach Ansicht von Robeco schädlich für die Gesellschaft sind, wie beispielsweise umstrittene Verhaltensweisen, umstrittene Waffen und bestimmte Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen.
2. Der Teilfonds bewirbt, durch eine Reduzierung der CO₂-, Wasser- und Abfall-Fußabdrücke einen kleineren ökologischen Fußabdruck zu haben als der allgemeine Marktindex, auf den in Anhang VI - Benchmarks verwiesen wird (der „allgemeine Marktindex“).
3. Der Teilfonds fördert die Einhaltung und Geschäftsausübung im Einklang mit der Allgemeinen Erklärung der Menschenrechte der Vereinten Nationen, den Arbeitsnormen der Internationalen Arbeitsorganisation (ILO), den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte (UNGPs), dem Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen, indem er Unternehmen, die gegen diese Grundsätze verstoßen, einer kritischen Prüfung unterzieht.
4. Der Teilfonds bewirbt, einen besseren gewichteten durchschnittlichen ESG-Score zu haben als der allgemeine Marktindex.
5. Der Teilfonds bewirbt, einen größeren Anteil von Unternehmen mit positivem SDG-Score (1, 2, 3) im Portfolio zu haben als der allgemeine Marktindex.

Es wurde kein Referenzwert für das Erreichen der von diesem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Investitionsstrategie

Der Robeco QI Global Multi-Factor High Yield ist ein aktiv verwalteter Fonds, der systematisch in High Yield Bonds investiert. Die Auswahl der Anleihen basiert auf einem quantitativen Modell, wie im Abschnitt zur Strategie der Anlagepolitik in Anhang I dieses Prospektes beschrieben. Der Teilfonds konzentriert sich auf das Engagement in eine Reihe von quantitativen Strategien auf diversifizierte Weise, insbesondere eine Strategie mit Fokus auf Anleihen mit geringer Volatilität; eine Strategie mit Fokus auf Anleihen mit einer attraktiven Bewertung (Value) und eine Strategie mit Fokus auf Anleihen von Unternehmen mit einem mittelfristig attraktiven Performance-Trend (Momentum). Die Strategie integriert auf laufender Basis Nachhaltigkeitsindikatoren als Bestandteil des Verfahrens für die Anleiheauswahl. Der Teilfonds wendet unter anderem normen- und aktivitätsbasierte Ausschlüsse, die Good Governance Policy sowie das SDG-Rahmenwerk von Robeco an und berücksichtigt wichtige nachteilige Auswirkungen im Investmentprozess. Weitere produktspezifische Informationen sind auf unserer Website und über die in den abschließenden Fragen dieser Offenlegung angegebenen Links zu finden. Bei einer Neugewichtung des Portfolios kann das Portfolio vorübergehend aber maximal 72 Stunden lang von seinen verbindlichen Auflagen abweichen. Davon ausgenommen ist die Einhaltung der Ausschlusspolitik, die jederzeit maßgeblich bleibt.

Benchmark

Nicht zutreffend.

Geplante Asset-Allokation

Das Produkt sieht vor, eine Mindestmenge an 20.0% nachhaltigen Investitionen zu tätigen. Alle Beteiligungen orientieren sich an den E/S-Merkmalen, mit Ausnahme der Beteiligungen der Kategorie "Sonstige", bei denen es sich überwiegend um Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente handelt.

Überwachung und Due Diligence

Robeco hat die Nachhaltigkeitsaspekte der Anlagestrategien in angemessene Due-Diligence-Prozesse und Verfahren für die Auswahl und Überwachung von Anlagen integriert, unter anderem unter Berücksichtigung der Risikobereitschaft und der Nachhaltigkeitsrisikomanagementrichtlinien von Robeco. Portfoliomanager und Analysten sind in erster Linie dafür verantwortlich, täglich eine Investment Due Diligence für ihre Strategien durchzuführen. Sie werden durch eine unabhängige Überwachung unterstützt, die von den Abteilungen Finanzrisikomanagement und Investitionsbeschränkungen durchgeführt wird.

Datenquellen, Methoden und Grenzen

Das Produkt nutzt mehrere Quellen für die Erhebung von Nachhaltigkeitsdaten. Robeco prüft die Datenqualität jedes Anbieters im Rahmen von Due-Diligence-Bewertungen, die die Überprüfung des Datenmodells, die Durchführung statistischer Prüfungen und die Bewertung der Abdeckung umfassen. Die Datenverarbeitung findet in verschiedenen Formen statt, wobei die Datenerfassung immer bevorzugt wird, um Betriebsrisiken oder unnötige menschliche Eingriffe zu vermeiden.

Robeco unterhält auf seiner Website umfassende Methodikdokumente zu unseren proprietären Analyse-Frameworks. Darüber hinaus verlässt sich Robeco bei einigen sozialen und ökologischen Merkmalen auf extern bezogene Inhalte, für die wir bestrebt sind, den besten Anbieter für jedes unserer Zielmerkmale auszuwählen. Die Haupteinschränkung der Methodik oder Datenquelle ist die fehlende Offenlegung des Unternehmens. Wie viele andere Finanzmarktteilnehmer haben auch wir Schwierigkeiten, angemessene Informationen über die wichtigsten nachteiligen Indikatoren zu finden. Um dieses Problem zu lösen, hat Robeco auf mehrere Datenanbieter zurückgegriffen, da jeder seine eigenen Stärken und Schwächen hat.

Engagement-Strategie

Die Positionen des Fonds sind Gegenstand des Auswahlprozesses im Rahmen des wertorientierten Programms der aktiven Einflussnahme von Robeco, das aus einem konstruktiven Dialog, in dem Investoren mit Unternehmen, in die sie investieren, darüber sprechen, wie sie ESG-Risiken managen und ESG-Chancen nutzen, und Einflussnahme als Stakeholder besteht. Obwohl diese Art der aktiven Einflussnahme nicht direkt mit der Strategie für ökologische oder soziale Anlagen des Fonds zusammenhängt, können nachteilige Auswirkungen auf die Nachhaltigkeit über das wertorientierte Programm der aktiven Einflussnahme besprochen werden.