

Überblicksdokument Robeco 3D US Equity UCITS ETF

Dieses Finanzprodukt fördert ökologische oder soziale Merkmale, hat aber nicht nachhaltige Anlagen zum Ziel.

Der Fonds weist die folgenden E/S-Eigenschaften auf:

- Der Fonds 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 und nicht kompatibel mit nachhaltigen Anlagestrategien sind.
- Der Fonds 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.
- Der Fonds nutzt die Stimmrechtsvertretung bei Hauptversammlungen zur Förderung guter Unternehmungsführungspraktiken und nachhaltiger unternehmerischer Handlungsweisen, die zur Schaffung von langfristigem Shareholder Value beitragen. Dazu gehört auch das Vertreten einer aktiven Haltung zu sozialen und ökologischen Themen über die Proxy Voting Policy von Robeco.

Es wurde kein Referenzwert festgelegt, um die von diesem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

Anlagestrategie

Robeco 3D US Equity UCITS ETF wird aktiv verwaltet und wendet die „3D“-Anlagestrategie des Fondsmanagers an, die darauf abzielt, Risiko, Rendite und Nachhaltigkeit im Portfolio des Fonds zu berücksichtigen. Das Portfolio des Fonds wird mithilfe eines quantitativen Prozesses optimiert, um Renditen über der Benchmark, bessere Nachhaltigkeitsmerkmale als die Benchmark und ein Risikomanagement im Vergleich zur Benchmark zu erreichen. Die drei Dimensionen Risiko, Rendite und Nachhaltigkeit werden in dem firmeneigenem quantitativen Aktienranking-Modell des Fondsmanagers zusammen berücksichtigt, das nachstehend näher erläutert wird.

Die Strategie integriert auf laufender Basis Nachhaltigkeitsindikatoren als Bestandteil des Verfahrens für die Aktienausswahl. 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 zu finden.

Geplante Vermögensallokation

Der Fonds beabsichtigt, einen Mindestbetrag von 60,0% in nachhaltige Anlagen zu investieren. Sämtliche Anlagen werden auf die E/S-Eigenschaften ausgerichtet, mit Ausnahme der Anlagen in der Kategorie „Sonstige“, die vor allem in Barmittel und Barmitteläquivalente angelegt werden.

Überwachung und Due Diligence-Prüfungen

Robeco hat die Nachhaltigkeitsaspekte der Anlagestrategien in angemessene Due Diligence-Prozesse vor Anlagen und Verfahren für die Auswahl und Überwachung von Anlagen integriert, wobei insbesondere der Risikoappetit und die Risikomanagementrichtlinien von Robeco berücksichtigt werden. Die Portfolio-Manager und Analysten sind für die tägliche Durchführung der Due Diligence-Prüfung vor Anlagen in ihren Strategien verantwortlich. Sie werden von einer unabhängigen Überwachung unterstützt, die von den Abteilungen für das Management finanzieller Risiken und Anlagebeschränkungen durchgeführt wird.

Datenquellen, Methoden und Beschränkungen

Der Fonds nutzt mehrere Quellen für die Erhebung von Nachhaltigkeitsdaten. Robeco untersucht die Datenqualität der einzelnen Anbieter während der Due Diligence-Bewertungen, was eine Überprüfung des Datenmodells, statistische Prüfungen und eine Bewertung der Abdeckung beinhaltet. Die Datenverarbeitung erfolgt in unterschiedlichen Formen, wobei einer möglichst stark automatisierte Datenerfassung immer Vorrang gegeben wird, um betriebliche Risiken oder unnötige menschliche Eingriffe zu vermeiden. Robeco führt auf unserer Website eine umfassende Dokumentation der Methoden unserer firmeneigenen Analyseframeworks. Außerdem bezieht sich Robeco bei einigen sozialen und ökologischen Eigenschaften auf von externen Quellen bezogenen Inhalte, bei denen wir uns bei jeder unserer angestrebten Eigenschaften um die Auswahl der besten Anbieter ihrer Klasse bemühen. Die wichtigste Einschränkung von Methoden oder Datenquellen geht von fehlender Offenlegung der Unternehmen aus. Wie viele andere Teilnehmer der Kapitalmärkte fällt es uns schwer, angemessene Informationen über Indikatoren für wichtige nachteilige Auswirkungen zu finden. Um dieses Problem zu überwinden greift Robeco auf mehrere Datenanbieter zurück, weil diese jeweils eigene Stärken und Schwächen haben.

Strategie zur aktiven Einflussnahme

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 ESG-Risiken managen und ESG-Chancen nutzen, und Einflussnahme als Stakeholder besteht. Obwohl diese Art der aktiven Einflussnahme nicht direkt mit dem nachhaltigkeitsbezogenen Anlageziel des Fonds zusammenhängt, können nachteilige Auswirkungen auf die Nachhaltigkeit über das wertorientierte Programm der aktiven Einflussnahme besprochen werden.