



Lupus alpha Investment GmbH, Frankfurt am Main

Wichtige Information für die Anteilhaber

Bestätigung über die Erfüllung der Vorgaben der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“)

Der Fonds „Lupus alpha Return (R)“ berücksichtigt bei Anlageentscheidungen Risiken im Zusammenhang mit Nachhaltigkeit und wird von der Lupus alpha Investment GmbH als Artikel 6 Fonds gem. SFDR klassifiziert. Der Fondsmanager prüft für den „Lupus alpha Return (R)“ die dabei auftretenden Nachhaltigkeitsrisiken unter Beachtung der Anlagepolitik des Fonds. Hierbei werden vor jeder Anlageentscheidung die Wertpapiere bzw. deren Emittenten z.B. anhand von ESG-Scores auf Nachhaltigkeitsrisiken hin analysiert. ESG-Informationen und ESG-Kriterien werden für Anlageentscheidungen berücksichtigt, sind jedoch nicht bestimmend, sodass das Fondsmanagement in Wertpapiere und Emittenten investieren kann, die nicht ESG Kriterien folgen. Nachhaltigkeitsrisiken können mittel- bis langfristig einen wesentlicheren Einfluss auf den Wert der Anlagen des „Lupus alpha Return (R)“ haben. Da eine Verschlechterung dieser ESG-Scores sowie auftretende Kontroversen von Zielunternehmen in die der Fonds investiert bereits kurz- oder mittelfristig negative Auswirkungen auf ein Investment des Fonds haben können, legt der Fondsmanager ein besonderes Augenmerk auf diese ESG-Kriterien und die Veränderungen im Zeitverlauf. Im Einzelfall wird geprüft, ob die Verschlechterung des ESG Score signifikant ist oder ob es sich um sehr schwere / schwere, strukturelle Kontroversen handelt. Weiterhin wird überprüft, wie die erwarteten Auswirkungen auf die Entwicklung der einzelnen Investments sind. Die Grundlage für die Analyse des Fondsmanagers bilden die Daten des Dienstleister MSCI ESG Research. Diese werden intern validiert und falls notwendig ergänzt. Informationen für ein fortwährendes Risikomanagement in Bezug auf Nachhaltigkeitsrisiken werden erstellt und genutzt. Eine Überprüfung regulatorischer Vorgaben findet regelmäßig statt.

Lupus alpha Investment GmbH
Speicherstraße 49–51
D-60327 Frankfurt am Main

Stand: September 2022