

C-QUADRAT ARTS Total Return ESG

AT0000618137, AT0000A218K9, AT0000A2RXC8, AT0000A2RXB0

Emittent	Ampega Investment GmbH
Fondsanbieter	Ampega Investment GmbH
Fondstyp/Asset Klasse	Aktienfonds
Rechtsform	UCITS
Auflage des Fonds	01.02.2021
Letzte Aktualisierung	09.01.2025
Benchmark	keine Benchmark
Tranche	Privatanleger Institutionelle Anleger



Risikoindikator (BIB)
4 von 7

Zugelassen in
D, A

Eingruppierung nach SFDR
Artikel 8

EU Taxonomie
-

Investitionsquote nach SFDR
-

Principal Adverse Impacts



Ziele für nachhaltige Entwicklung



REGELMÄSSIGE ALLOKATION

Aktien	0 % bis 100 %
Anleihen	0 % bis 100 %
Geldmarkt/Bankeinlagen	0 % bis 100 %
Rohstoffe	Ausgeschlossen
Direktbeteiligungen	Ausgeschlossen
Derivate	0 % bis 49 % (nur zur Absicherung)
Weitere	-

Nachhaltigkeitsansatz

Principal Adverse Impacts	✓ Treibhausgasemissionen ✓ Wasser ✓ Abfälle ✓ Biodiversität ✓ Energieeffizienz und fossile Brennstoffe ✓ Soziale und Arbeitnehmerbelange
Erläuterungen zur Berücksichtigung der SDGs	-

Begründung der Eingruppierung nach SFDR	Artikel 8 Der C-QUADRAT ARTS Total Return ESG ist ein Finanzprodukt, mit dem ökologische und soziale Merkmale im Rahmen der Anlagestrategie beworben werden und qualifiziert sich gemäß Artikel 8 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.
Engagement	Nein
Stimmrechtsausübung	Ja, extern organisiert 🔗 Link zur Abstimmungsrichtlinie
Best-in/of-Class Auswahlverfahren	Best-In-Class Seitens ISS ESG wird das Grunduniversum bestehend aus allen benötigten „Rohdaten“ zur Verfügung gestellt. Diese Daten umfassen Nachhaltigkeitsratings aller Unternehmen, sogenannte „ESG Corporate Ratings“ sowie auch einen Performance Score und Stammdaten wie Namen, ISIN, Industrie-Gruppe (Branche) und mehr. Aktuell werden für mehr als 7.500 Emittenten „Nachhaltigkeits-Ratings“ erstellt, die laufend überprüft und auf monatlicher Basis in Form von Masterfiles zur Verfügung gestellt werden. Diese Masterfiles, welche das kontroverse Screening nach FNG und nach den Richtlinien des UZ49 beinhalten, werden in weiterer Folge von ARTS automatisiert verarbeitet und in eine Datenstruktur eingespielt. Danach wird der relative Best-In-Class Ansatz wie folgt definiert: 1. Das Universum wird nach ESG-Rating und ESG-Performance-Score sortiert, hier gilt je höher desto besser 2. Danach wird nach Industrie (Branche) gruppiert 3. Innerhalb jeder Industrie-Gruppe wird jedem Emittenten ein Rang (Branchen-Ranking) zugewiesen (je höher desto besser) 4. Better-Than-Average - Aus dem Anlageuniversum sollen somit diejenigen Unternehmen und Staaten ausgewählt werden, die überdurchschnittliche Nachhaltigkeitsleistungen erbringen. Nach diesem Prinzip werden die Unternehmen innerhalb einer Branche sowie die Staaten direkt miteinander verglichen und auf ihre Nachhaltigkeit überprüft. Dadurch werden jene bevorzugt, die die Nachhaltigkeitskriterien Environmental, Social und Governance („ESG“) jeweils überdurchschnittlich erfüllen, also besser als der Durchschnitt („Better-Than-Average“) sind. Somit werden nur diejenigen Unternehmen innerhalb einer Branche zugelassen, deren Ranking größer (und damit besser) als das Median-Ranking ist, die restlichen Unternehmen werden ausgefiltert. Das Median-Ranking wird dabei stets konservativ auf die nächste Ganzzahl aufgerundet. Spezialfälle, wenn zwei Emittenten mit identem Rating und Score im Median liegen, werden somit ebenfalls ausgesondert und fallen aus dem Universum. Dadurch wird gewährleistet, dass zu jedem Zeitpunkt mindestens 50% an Unternehmen einer Industrie (Branche) ausgesondert werden. 5. Das finale Universum umfasst schlussendlich mehr als 3.200 Unternehmen, aus welchem das ARTS-Handelssystem die jeweils potenziell trendstärksten Kandidaten selektiert und nach entsprechendem Prüfprozess in das Portfolio aufnimmt. Darüber hinaus stehen auch Renten-Emissionen von Nationen (Sovereigns) zur Verfügung. Auch diese werden nach obigem Prozess gefiltert, wobei rund 25 Staaten, deren Emissionen den Anforderungen genügen, im Anlageuniversum für mögliche Investitionen verbleiben. Nach Finalisierung des Universums, wird dieses datenbankseitig archiviert und ist damit auch historisch dokumentiert und damit auch zu späteren Zeitpunkten transparent und nachvollziehbar.
ESG-Integration	Ja Der Fonds hält eine Mindestquote von 1 % des Wertes des Fonds in nachhaltigen Investments gemäß Art. 2 Nr. 17 der Offenlegungsverordnung. Nachhaltige Investitionen gemäß Art. 2 Nr. 17 der Offenlegungsverordnung sind Investitionen in wirtschaftliche Tätigkeiten, die zur Erreichung eines Umwelt- oder Sozialziels beitragen dabei kein anderes dieser Ziele erheblich beeinträchtigen und zudem die investierbaren Unternehmen die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden. Nachhaltige Investitionen werden als Beitrag zu den 17 Nachhaltigkeitszielen der Vereinten Nationen (Sustainable Development Goals, „SDGs“) klassifiziert.
Normbasiertes Screening	✓ UN Global Compact ✓ ILO-Kernarbeitsnormen ✓ OECD Richtlinien für Multinationale Unternehmen
Themen	✓ SDGs SDGs werden über den SDG Solutions Score - Overall Score von ISS ESG berücksichtigt => Der Fonds hat eine Mindestquote von 1% in nachhaltigen Investments gemäß Art. 2 Nr. 17 der Offenlegungsverordnung festgelegt (lt. VKP).
Impact Investing	-
Nachhaltigkeitsansatz des Fondsanbieters	Der Fonds verfolgt eine aktive Managementstrategie und orientiert sich an keiner Benchmark. Es wird vielmehr angestrebt, auf langfristige Sicht gesehen einen absoluten Wertzuwachs nach ethisch-nachhaltigen Veranlagungskriterien zu erwirtschaften. Der Investmentprozess erfolgt anhand eines quantitativen Handelsansatzes in Übereinstimmung mit den jeweiligen Bestimmungen des Investmentfonds und gleichzeitig adäquater Berücksichtigung von Nachhaltigkeitsfaktoren. ARTS Asset Management als Spezialist für quantitative Handelssysteme, arbeitet im Nachhaltigkeitsbereich mit dem renommierten Analysehaus ISS ESG zusammen, welches das Nachhaltigkeitsresearch übernimmt und der ARTS-Strategie das Veranlagungsuniversum zur Verfügung stellt. Bei der Portfolioallokation werden ausschließlich Titel aus diesem vorselektierten Universum, sprich Werte die zum Zeitpunkt des Einsatzes im Einklang mit den Auflagen des österreichischen Umweltzeichens (kurz UZ49) als auch des FNG-Siegels stehen, eingesetzt. Dadurch soll der Fonds Unternehmungen sowie Staaten unterstützen, die verantwortungsvoll mit Umwelt-, Sozialen, und Governance-Themen umgehen. Gleichermaßen versucht das trendfolgende Handelssystem langfristig positive Erträge zu generieren und durch aktives Risikomanagement seine Investoren vor großen Kursrückschlägen zu bewahren. Investiert wird in die jeweils trendstärksten Unternehmen aus verschiedenen nachhaltigen Branchen und Regionen. Das professionelle Total Return Konzept sorgt für ein systematisches Risikomanagement und kann in einer positiven Aktienmarktpphase mit einer Quote bis zu 100 Prozent am Aktienmarkt partizipieren. Um in negativen Börsenzeiten das Risiko zu begrenzen, können Aktien reduziert und das (Netto)-Aktienrisiko über Derivate bis auf 0 Prozent abgesichert bzw. in weniger risikoreiche Renten-Emissionen von Staaten, die als nachhaltig im Sinne des UZ49 und des FNG-Siegels eingestuft werden oder geldmarktnahe Anlagen ausgewichen werden. Der Fonds wird dabei jedoch stets eine physische Mindestquote von 51% an Wertpapieren halten. Eine darunter liegende Netto-Aktienquote wird durch Absicherung („Hedging“) über derivative Finanzinstrumente erreicht. Dies kann aber auch bedeuten, dass der Anleger über einen längeren Zeitraum nicht an der Aktienertragskomponente partizipiert. 🔗 Link zum Nachhaltigkeitsansatz

Research und Tranzparenz

Interne Nachhaltigkeitsanalyse	Ja, 5
Researchpartner	Ja ISS ESG
%-Anteil des Portfolios mit Nachhaltigkeitsanalyse	100 %
Einbezug von strategisch wichtigen Zulieferern	Nein
Nachhaltigkeitsbeirat	Nein
CO2 Portfolio Analyse	Nein
Nachhaltigkeitsreporting	Ja https://www.arts.co.at/Funds/Fund/AT0000618137
Mind. monatliche Portfolioveröffentlichung	Ja ↗ Link zur monatlichen Portfolioveröffentlichung
Zertifizierung/Auszeichnung durch unabhängige Auditoren	✓ FNG-Siegel ★ ✓ Österreichisches Umweltzeichen

Umwelt

AUSSCHLUSS VON BRANCHEN/GESCHÄFTSFELDERN UNTERNEHMEN

Fossile Brennstoffe (Kohle, Öl und Gas)	Ja 5 % Umsatztoleranz
Kernenergie (Betrieb und Komponenten)	Ja 5 % Umsatztoleranz
Grüne Gentechnik	Ja 5 % Umsatztoleranz
Chlor und Agrochemie (Biozide)	Nein
Weitere	Stammzellenforschung (Klonierungsverfahren im Humanbereich und humane Embryonenforschung)

AUSSCHLUSS VON GESCHÄFTSPRAKTIKEN UNTERNEHMEN

Umweltschädliches Verhalten	Ja
Schädigung der Biodiversität	Ja
Weitere	Fracking & Ölsand

AUSSCHLUSSKRITERIEN STAATEN

Nichtratifizierung Pariser Klimaabkommen	Ja
Nichtratifizierung des Protokolls über biolog. Sicherheit	Nein
Nichtratifizierung der UN-Biodiversitäts-Konvention	Ja
Kernenergie nach Anteil an der Bruttoenergieerzeugung	Ja
Weitere	Verstoß gegen Atomwaffensperrvertrag

Soziales

AUSSCHLUSS VON BRANCHEN/GESCHÄFTSFELDERN UNTERNEHMEN

Waffen/Rüstungsgüter	Ja 5 % Umsatztoleranz
Streubomben und Antipersonenminen	Ja
Massenvernichtungswaffen (ABC/CBRN)	Ja
Tabakwaren	Ja 5 % Umsatztoleranz
Pornographie	Nein
Spirituosen/Alkohol	Nein
Glücksspiel	Nein
Weitere	Stammzellen Forschung

AUSSCHLUSS VON GESCHÄFTSPRAKTIKEN UNTERNEHMEN

Arbeitsrechte (ILO Kernarbeitsnormen)	Ja
Ausbeuterische Kinderarbeit	Ja
Menschenrechtsverletzung	Ja
Tierversuche	Nein
Weitere	-

AUSSCHLUSSKRITERIEN STAATEN

Arbeitsrechte	Ja
Menschenrechtsverletzung	Ja
>3% - Anteil Rüstungsausgaben vom BIP	Ja
Todesstrafe, Folter	Ja
Unfreie Staaten laut Freedom House	Ja
Verstöße gegen den Atomwaffensperrvertrag	Ja
Verstöße gegen sonstige Waffensperrverträge	Ja
Weitere	Diskriminierung, Meinungsfreiheit, Versammlungsfreiheit, Pressefreiheit

Governance

AUSSCHLUSS VON GESCHÄFTSPRAKTIKEN UNTERNEHMEN

Korruption und Bestechung	Ja
Steuer: planmäßige Vermeidung & festgestellte Verstöße	Nein
Weitere	Waffen und Rüstung, Kernkraft inkl. Uranbergbau, Kohle (Bergbau & bedeuts. Verstromung, Facking & Ölsand, UN Global Compact

AUSSCHLUSSKRITERIEN STAATEN

Korruption	Ja
Weitere	Verstoß gegen Atomwaffensperrvertrag, Kinderarbeit, Todesstrafe, Klimaschutz, Versammlungsfreiheit

Quelle: Unternehmensangaben. | Für die Angaben der Unternehmen kann keine Haftung übernommen werden. Die Angaben dienen nur zur Information und stellen keine Beratung oder Empfehlung dar. Bitte beachten Sie den Haftungsausschluss unter www.forum-ng.org/disclaimer. Das FNG-Nachhaltigkeitsprofil bietet nur einen ersten Überblick und ist kein Ersatz für eine eigenständige Analyse. Weiterführende Erläuterungen finden Sie unter www.forum-ng.org