

CONVEX  
EXPERTS GMBH

# CONVEX Experts

---

OFFENLEGUNG

## Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren im CONVEX Conservative Sustainable Convertibles

Die Messung der nachteiligen Nachhaltigkeitsauswirkungen erfolgt mittels den in der Offenlegungsverordnung definierten obligatorischen Indikatoren sowie den beiden zusätzlichen Indikatoren „Emissionen von Luftschadstoffen“ (Tabelle 2, Indikator 2) und „Unfallquote“ (Tabelle 3, Indikator 2). Weitere Indikatoren werden aktuell nicht verwendet. Für jeden dieser Indikatoren sind Informationen beigefügt, um die Maßnahmen zu beschreiben, welche die CONVEX Experts GmbH für den CONVEX Conservative Sustainable Convertibles ergriffen hat, und ggf. die Maßnahmen, die sie zu ergreifen plant bzw. die Ziele, die sie sich gesetzt hat, um die wichtigsten festgestellten nachteiligen Auswirkungen zu vermeiden oder zu verringern.

INDIKATOREN FÜR INVESTITIONEN IN UNTERNEHMEN, IN DIE INVESTIERT WIRD				
Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Einheit	Messgröße	Erläuterung	Ergriffene und geplante Maßnahmen und Ziele für den nächsten Bezugszeitraum
KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEZOGENE INDIKATOREN				
Treibhausgasemissionen				
1. THG-Emissionen - Scope 1 Treibhausgasemissionen	Tonnen	Scope-1-Treibhausgasemissionen	Aufgrund der aktuell noch nicht vollständigen und qualitativ ausreichenden Datenverfügbarkeit liegen nicht für alle Investitionen Werte vor.	<p><b>Allgemeiner Ansatz</b> Neben unserer ESG-Politik berücksichtigen alle Assets unter Management die globalen Rahmenwerke UNGC Prinzipien, OECD-Richtlinien für MNE und ILO-Kernarbeitsnormens. Dieser Fonds ist nach dem FNG-Siegel zertifiziert. Unser ESG-Bewertungssystem basiert auf diesen Grundlagen und integriert kontinuierlich die PAIs 1-6 in unser internes Überwachungssystem.</p> <p><b>Engagement</b> Im Rahmen unser Engagement-Strategie führt unser ESG-Dienstleister The Value Group Engagement durch mit den höchsten Emittenten unserer investierten Portfolien.</p> <p><b>Weitere Maßnahmen</b> Derzeit sind keine weiteren Maßnahmen geplant, aber für Emittenten mit auffälligen Werten können weitere Schritte eingeleitet werden. Konkrete Ziele im Sinne von nachhaltigen Investitionen gemäß Art 9 werden nicht verfolgt.</p>
THG-Emissionen - Scope 2 Treibhausgasemissionen	Tonnen	Scope-2-Treibhausgasemissionen	Aufgrund der aktuell noch nicht vollständigen und qualitativ ausreichenden Datenverfügbarkeit liegen nicht für alle Investitionen Werte vor.	
THG-Emissionen - Scope 3 Treibhausgasemissionen	Tonnen	Scope-3-Treibhausgasemissionen	Aufgrund der aktuell noch nicht vollständigen und qualitativ ausreichenden Datenverfügbarkeit liegen nicht für alle Investitionen Werte vor.	
THG-Emissionen insgesamt	Tonnen	THG-Emissionen insgesamt	Aufgrund der aktuell noch nicht vollständigen und qualitativ ausreichenden Datenverfügbarkeit liegen nicht für alle Investitionen Werte vor.	

2. CO2-Fußabdruck	Tonnen je 1 Mio. € Umsatz	CO2-Fußabdruck	NA
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird	Tonnen pro mio. EUR	THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird	NA
4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind	Prozentualer Anteil der Investitionen	Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind	NA
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen - Konsum und Produktion	Prozent	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen	Investitionen ohne vorhandene Daten wurden bei der Berechnung dieser Kennzahl aus dem Nenner (gegenwärtiger Wert aller Investitionen) herausgerechnet.
6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren - Sektor A	GWh pro mio. EUR	Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	Investitionen ohne vorhandene Daten wurden bei der Berechnung dieser Kennzahl aus dem Nenner (gegenwärtiger Wert aller Investitionen) herausgerechnet.
6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren - Sektor B	GWh pro mio. EUR	Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	Investitionen ohne vorhandene Daten wurden bei der Berechnung dieser Kennzahl aus dem Nenner (gegenwärtiger Wert aller Investitionen) herausgerechnet.
6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren - Sektor C	GWh pro mio. EUR	Verarbeitendes Gewerbe	Investitionen ohne vorhandene Daten wurden bei der Berechnung dieser Kennzahl aus dem Nenner (gegenwärtiger Wert aller Investitionen) herausgerechnet.
6. Intensität des Energieverbrauchs nach	GWh pro mio. EUR	Energieversorgung	Investitionen ohne vorhandene Daten wurden bei der Berechnung dieser Kennzahl aus dem Nenner

klimateintensiven Sektoren - Sektor D			(gegenwärtiger Wert aller Investitionen) herausgerechnet.
6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimateintensiven Sektoren - Sektor E	GWh pro. mio. EUR	Wasserversorgung, Abwasser- und Abfallentsorgung	Investitionen ohne vorhandene Daten wurden bei der Berechnung dieser Kennzahl aus dem Nenner (gegenwärtiger Wert aller Investitionen) herausgerechnet.
6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimateintensiven Sektoren - Sektor F	GWh pro. mio. EUR	Bau	Investitionen ohne vorhandene Daten wurden bei der Berechnung dieser Kennzahl aus dem Nenner (gegenwärtiger Wert aller Investitionen) herausgerechnet.
6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimateintensiven Sektoren – Sektor G	GWh pro. mio. EUR	Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	Investitionen ohne vorhandene Daten wurden bei der Berechnung dieser Kennzahl aus dem Nenner (gegenwärtiger Wert aller Investitionen) herausgerechnet.
6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimateintensiven Sektoren - Sektor H	GWh pro. mio. EUR	Verkehr und Lagerei	Investitionen ohne vorhandene Daten wurden bei der Berechnung dieser Kennzahl aus dem Nenner (gegenwärtiger Wert aller Investitionen) herausgerechnet.
6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimateintensiven Sektoren - Sektor L	GWh pro. mio. EUR	Grundstücks- und Wohnungswesen, Vermietung und Unternehmensdienstleistungen	Investitionen ohne vorhandene Daten wurden bei der Berechnung dieser Kennzahl aus dem Nenner (gegenwärtiger Wert aller Investitionen) herausgerechnet.

#### Biodiversität

7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken	Prozentualer Anteil der Investitionen	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, mit Standorten/Betrieben in oder in der Nähe von Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, sofern sich die Tätigkeiten dieser Unternehmen nachteilig auf diese Gebiete auswirken	Aufgrund der aktuell noch nicht vollständigen und qualitativ ausreichenden Datenverfügbarkeit liegen nicht für alle Investitionen Werte zu den Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken, vor.
---	---------------------------------------	---	---

#### Allgemeiner Ansatz

Neben unserer ESG-Politik berücksichtigen alle Assets unter Management die globalen Rahmenwerke UNGC Prinzipien, OECD-Richtlinien für MNE und ILO-Kernarbeitsnormen. Dieser Fonds ist nach dem FNG-Siegel zertifiziert. Unser ESG-Bewertungssystem basiert auf diesen Grundlagen und integriert kontinuierlich die PAIs 7-9 in unser internes Überwachungssystem.

#### Ausschlüsse

Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und FNG-Kriterien sowie die Beteiligung an bestimmten Geschäften und Verhaltensweisen führen zum Ausschluss von Titeln aus dem Investitionsuniversum.

#### Engagement

#### Wasser

8. Emissionen in Wasser	Tonnen pro mio. EUR	Tonnen Emissionen in Wasser, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR verursacht werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt	Investitionen ohne vorhandene Daten wurden bei der Berechnung dieser Kennzahl aus dem Nenner (gegenwärtiger Wert aller Investitionen) herausgerechnet.	Im Rahmen unser Engagement-Strategie führt unser ESG-Dienstleister The Value Group Engagement durch mit Unternehmen, die Ausschlussgründe aufweisen. <b>Weitere Maßnahmen</b> Derzeit sind keine weiteren Maßnahmen geplant, aber Emittenten mit auffälligen Werten können weiteren Analysen unterzogen werden. Konkrete Ziele im Sinne von nachhaltigen Investitionen gemäß Art. 9 werden nicht verfolgt.
<b>Abfall</b>				
9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle	Tonnen pro mio. EUR	Tonnen gefährlicher und radioaktiver Abfälle, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR erzeugt werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt	Investitionen ohne vorhandene Daten wurden bei der Berechnung dieser Kennzahl aus dem Nenner (gegenwärtiger Wert aller Investitionen) herausgerechnet.	
<b>INDIKATOREN IN DEN BEREICHEN SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG</b>				
<b>Soziales und Beschäftigung</b>				
10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen	Prozentualer Anteil der Investitionen	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren	NA	<b>Allgemeiner Ansatz</b> Neben unserer ESG-Politik berücksichtigen alle Assets unter Management die globalen Rahmenwerke UNGC Prinzipien, OECD-Richtlinien für MNE und ILO-Kernarbeitsnormens. Dieser Fonds ist nach dem FNG-Siegel zertifiziert. Unser ESG-Bewertungssystem basiert auf diesen Grundlagen und integriert kontinuierlich die PAIs 10-13 in unser internes Überwachungssystem. <b>Ausschlüsse</b> Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und FNG-Kriterien sowie die Beteiligung an bestimmten Geschäften und Verhaltensweisen führen zum Ausschluss von Titeln aus dem Investitionsuniversum.
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen	Prozentualer Anteil der Investitionen	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die keine Richtlinien zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder keine Verfahren zur Bearbeitung von Beschwerden wegen	NA	<b>Engagement</b> Im Rahmen unser Engagement-Strategie führt unser ESG-Dienstleister The Value Group Engagement durch mit Unternehmen, die Kontroversen aufweisen. <b>Weitere Maßnahmen</b> Derzeit sind keine weiteren Maßnahmen geplant, aber falls Unregelmäßigkeiten auftreten, können weitere Schritte eingeleitet werden. Konkrete Ziele im Sinne von nachhaltigen Investitionen gemäß Art. 9 werden nicht verfolgt.

		Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen eingerichtet haben		
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle	Prozent	Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle bei den Unternehmen, in die investiert wird	Investitionen ohne vorhandene Daten wurden bei der Berechnung dieser Kennzahl aus dem Nenner (gegenwärtiger Wert aller Investitionen) herausgerechnet.	
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	Prozentualer Anteil an Frauen	Durchschnittliches Verhältnis von Frauen zu Männern in den Leitungs- und Kontrollorganen der Unternehmen, in die investiert wird, ausgedrückt als Prozentsatz aller Mitglieder der Leitungs- und Kontrollorgane	Investitionen ohne vorhandene Daten wurden bei der Berechnung dieser Kennzahl aus dem Nenner (gegenwärtiger Wert aller Investitionen) herausgerechnet.	
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	Prozentualer Anteil der Investitionen	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind	NA	<p><b>Allgemeiner Ansatz</b> Unsere ESG-Politik schließt für alle Assets under Management Investitionen in Unternehmen aus, die an der Produktion oder Entwicklung kontroverser Waffen beteiligt sind. Unser ESG-Bewertungssystem basiert hierauf und integriert kontinuierlich den PAI 14 in unser internes Überwachungssystem.</p> <p><b>Ausschlüsse</b> Unser ESG-Ansatz schließt für alle Assets under Management Investitionen in Unternehmen aus, die an der Produktion oder Entwicklung kontroverser Waffen beteiligt sind.</p> <p><b>Engagement</b> Im Rahmen unserer Engagement-Strategie führt unser ESG-Dienstleister The Value Group Engagement durch mit Unternehmen, die Kontroversen aufweisen.</p> <p><b>Weitere Maßnahmen</b> Derzeit sind keine weiteren Maßnahmen geplant. Konkrete Ziele im Sinne von nachhaltigen Investitionen gemäß Art. 9 werden nicht verfolgt.</p>

Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen

Umwelt

15. THG-Emissionsintensität	Tonnen pro mio. EUR	THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird	Investitionen ohne vorhandene Daten wurden bei der Berechnung dieser Kennzahl aus dem Nenner (gegenwärtiger Wert aller Investitionen) herausgerechnet.	<p><b>Allgemeiner Ansatz</b> Neben unserer ESG-Politik berücksichtigen alle Assets unter Management die globalen Rahmenwerke UNGC Prinzipien, OECD-Richtlinien für MNE und ILO-Kernarbeitsnormens. Dieser Fonds ist nach dem FNG-Siegel zertifiziert. Unser ESG-Bewertungssystem basiert auf diesen Grundlagen und integriert kontinuierlich den PAI 15 in unser internes Überwachungssystem.</p> <p><b>Ausschlüsse</b> Alle Assets unter Management schließen Ländertitel aus, für welche kein Paris-Klimaschutzabkommen vorliegt.</p> <p><b>Weitere Maßnahmen</b> Derzeit sind keine weiteren Maßnahmen geplant, aber für Emittenten mit auffälligen Werten können weitere Schritte eingeleitet werden. Konkrete Ziele im Sinne von nachhaltigen Investitionen gemäß Art. 9 werden nicht verfolgt.</p>
<b>Soziales</b>				
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen	Prozentualer Anteil der Investitionen	Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird)	NA	<p><b>Allgemeiner Ansatz</b> Neben unserer ESG-Politik berücksichtigen alle Assets unter Management die globalen Rahmenwerke UNGC Prinzipien, OECD-Richtlinien für MNE und ILO-Kernarbeitsnormens. Dieser Fonds ist nach dem FNG-Siegel zertifiziert. Unser ESG-Bewertungssystem basiert auf diesen Grundlagen und integriert kontinuierlich den PAI 16 in unser internes Überwachungssystem.</p> <p><b>Ausschlüsse</b> Verstöße gegen die Demokratie und Menschenrechte führen bei allen Assets unter Management zum Ausschluss von Titeln aus dem Investitionsuniversum.</p> <p><b>Engagement</b> Im Rahmen unser Engagement-Strategie führt unser ESG-Dienstleister The Value Group Engagement durch mit Unternehmen, die UNGC-Kontroversen aufweisen.</p> <p><b>Weitere Maßnahmen</b> Derzeit sind keine weiteren Maßnahmen geplant, aber falls Unregelmäßigkeiten auftreten, können weitere Schritte eingeleitet werden. Konkrete Ziele im Sinne von nachhaltigen Investitionen gemäß Art. 9 werden nicht verfolgt.</p>
<b>Indikatoren für Investitionen in Immobilien</b>				
<b>Fossile Brennstoffe</b>				
17. Engagement in fossilen Brennstoffen durch die Investition in Immobilien	Prozentualer Anteil der Investitionen	Anteil der Investitionen in Immobilien, die im Zusammenhang mit der		Nicht anwendbar

		Gewinnung, der Lagerung, dem Transport oder der Herstellung von fossilen Brennstoffen stehen		
<b>Energieeffizienz</b>				
18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz	GWh pro mio. EUR	Anteil der Investitionen in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz	Für die Investitionen in Immobilien liegen zum aktuellen Zeitpunkt keine hinreichenden Informationen vor. Vor diesem Hintergrund ist kein Ausweis einer aussagekräftigen Kennzahl möglich.	Nicht anwendbar
<b>Weitere Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren</b>				
<b>KLIMAINDIKATOREN UND ANDERE UMWELTBEOZUGENE INDIKATOREN</b>				
Emissionen von Luftschadstoffen	Tonnen pro mio. EUR	Tonnen Äquivalent Luftschadstoffe pro investierter Million EUR, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt	Investitionen ohne vorhandene Daten wurden bei der Berechnung dieser Kennzahl aus dem Nenner (gegenwärtiger Wert aller Investitionen) herausgerechnet.	<p><b>Allgemeiner Ansatz</b> Neben unserer ESG-Politik berücksichtigen alle Assets unter Management die globalen Rahmenwerke UNGC Prinzipien, OECD-Richtlinien für MNE und ILO-Kernarbeitsnormens. Dieser Fonds ist nach dem FNG-Siegel zertifiziert. Unser ESG-Bewertungssystem basiert auf diesen Grundlagen und integriert kontinuierlich den PAI II.2 in unser internes Überwachungssystem.</p> <p><b>Weitere Maßnahmen</b> Derzeit sind keine weiteren Maßnahmen geplant, aber für Emittenten mit auffälligen Werten können weitere Schritte eingeleitet werden. Konkrete Ziele im Sinne von nachhaltigen Investitionen gemäß Art. 9 werden nicht verfolgt.</p>
<b>INDIKATOREN IN DEN BEREICHEN SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG</b>				
Unfallquote	Unfälle pro mio. gearbeitete Stunden	Unfallquote in Unternehmen, in die investiert wird, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt	Investitionen ohne vorhandene Daten wurden bei der Berechnung dieser Kennzahl aus dem Nenner (gegenwärtiger Wert aller Investitionen) herausgerechnet.	<p><b>Allgemeiner Ansatz</b> Neben unserer ESG-Politik berücksichtigen alle Assets unter Management die globalen Rahmenwerke UNGC Prinzipien, OECD-Richtlinien für MNE und ILO-Kernarbeitsnormens. Dieser Fonds ist nach dem FNG-Siegel. Unser ESG-Bewertungssystem basiert auf diesen Grundlagen und integriert kontinuierlich den PAI III.2 in unser internes Überwachungssystem.</p> <p><b>Ausschluss</b> Verstöße gegen Sicherheit und Gesundheit führen zum Ausschluss von Titeln aus dem Investitionsuniversum.</p> <p><b>Weitere Maßnahmen</b> Derzeit sind keine weiteren Maßnahmen geplant, aber falls Unregelmäßigkeiten auftreten, können weitere Schritte eingeleitet</p>



werden. Konkrete Ziele im Sinne von nachhaltigen Investitionen gemäß Art. 9 werden nicht verfolgt.

The Value Group hat die verpflichtenden und zusätzlichen Indikatoren zugeordnet und dabei plausible Proxies genutzt, wenn berichtete und offengelegte Daten fehlen. Weiterführende Angaben zum ESG-Ansatz inklusiver der Definitionen der Ausschlusskriterien sind online abrufbar unter <https://convex-experts.com/top50smartesgconvertibles/> → Handbuch zur Nachhaltigen Vermögensveranlagung.

---

