

**Premium Selection UCITS ICAV**

**Julius Baer Edelweiss Swiss Equity – ein Teilfonds des Premium Selection UCITS ICAV– Zusammenfassung der Offenlegungen gemäß SFDR – 07.06.2024.**

**Nachhaltiges Investitionsziel**– Der Fonds bewirbt ökologische oder soziale Merkmale, strebt aber keine nachhaltigen Investitionen an.

**Ökologische/Soziale Merkmale des Fonds**– Der Fonds bewirbt die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale: \*Klimaschutz und Anpassung an den Klimawandel; \*Erhaltung der Biodiversität; \*Vernünftige Arbeitsbedingungen; \*Einhaltung globaler Normen.

Um sicherzustellen, dass der Fonds sein ESG-Profil aufrecht erhält, muss er in Instrumente investieren, die die Schwellenwerte der hausinternen **Rating-Methodik für nachhaltige Investitionen** des Anlageverwalters einhalten.

Der Anlageverwalter verwendet eine Klimabewertung, die sich auf die Treibhausgasemissionen und die Risiken des Unternehmens hinsichtlich des Übergangs auf eine Netto-Null-Welt erstreckt. Die Grundlage für die Klimabewertung bildet die Intensität der Kohlenstoffemissionen als entweder zu Scope 1 oder zu Scope 2 gehörend (die wichtigsten Indikatoren für nachteilige Auswirkungen), die die Kohlenstoffemissionen auf die Größe des Unternehmens, in das investiert wird, übertragen. Die Bewertung im Hinblick auf das Naturkapital betrifft die Themen Biodiversität und Verschmutzung. Sie ermöglicht die Identifizierung von Unternehmen mit erheblichen Risiken und Auswirkungen in Bezug auf Umweltbelange, die über das Klima hinausgehen. Der Global Norms Score (Bewertung im Hinblick auf weltweite Normen) konzentriert sich auf die geschäftlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, und auf die Einhaltung weltweit anerkannter Normen in Bezug auf Menschen- und Arbeitsrechte sowie verantwortungsbewusste Geschäftspraktiken. Der Human Capital Score (Humankapitalbewertung) bezieht sich auf die Beschäftigungsverhältnisse und die Entwicklung der Mitarbeiter sowie die Arbeitsplatzpolitik.

**Die Anlagestrategie des Fonds.** Der Fonds investiert vorrangig in die Aktien von Schweizer Unternehmen, die im SPI notiert und in CHF denominiert sind. Es wird erwartet, dass das investierbare Universum etwa 80-100 Aktienwerte umfassen wird. Das Portfolio besteht hauptsächlich aus zwei Anlageklassen – Barmittel und Aktien – und wird fast ausschließlich auf Einzeltitelbasis konstruiert.

**Methodik zur Messung der Erreichung der vom Fonds beworbenen sozialen oder ökologischen Merkmale** – Der Fonds bewirbt ökologische oder soziale Merkmale, indem er in Instrumente investiert, die der vom Anlageverwalter entwickelten Rating-Methodik für nachhaltige Investitionen (die „Methodik für nachhaltige Anlagen“) entsprechen. Die Methodik für nachhaltige Anlagen hat eine Struktur mit drei Ebenen:   
(1) Auf der ersten Ebene werden unverarbeitete ESG-Daten von verschiedenen externen Datenanbietern sowie das hausinterne themenorientierte Research zu Anlagethemen gesammelt, die mit nachhaltigen Zielen verbunden sind. (2) Anschließend werden bestimmte thematische Bewertungen aus den unverarbeiteten ESG-Daten und dem hausinternen themenorientierten Research berechnet. (3) Auf der letzten Ebene werden vier verschiedene ESG-Kategorien abgeleitet. Dabei wird eine Kombination aus den themenorientierten Bewertungen und bestimmten Indikatoren (verarbeitete ESG-Daten wie z. B. Ratings) verwendet, die direkt von verschiedenen ESG-Datenanbietern bereitgestellt werden. Die aus dem Prozess abgeleiteten vier ESG-Kategorien sind *„ESG-Risiko“, „Traditionell“, „Verantwortlich“ und „Nachhaltig“*.   
 **Anteil der Investitionen mit ökologischen/sozialen Merkmalen**– Mindestens 70 % des Fondsvermögens werden stets in Finanzinstrumente investiert, die vom Anlageverwalter als „verantwortlich“ oder „nachhaltig“ eingestuft werden.   
**Verbindliche Elemente der Anlagestrategie**– Der Fonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale, indem er mindestens 70 % der Vermögenswerte des Fonds in Finanzinstrumente investiert, die der Anlageverwalter als verantwortungsvoll oder nachhaltig klassifiziert. Die verbleibenden 30 % werden in Finanzinstrumente investiert, die als traditionell gelten oder in solche, denen der Anlageverwalter keine ESG-Kategorie zugewiesen hat.  
 In jedes vom Ausnahmeausschuss genehmigte Instrument.

**Überwachung der ökologischen/sozialen Merkmale**– Der Anlageverwalter hat die Bewertung von Nachhaltigkeitsrisiken in den Prozess der Anlageentscheidung für den Fonds aufgenommen, und zwar sowohl mittels einer ersten Sorgfaltsprüfung als Teil des Anlageprozesses als auch im Rahmen der anschließenden kontinuierlichen Überwachung der Fondsanlagen. Die Einbeziehung der Bewertungen von Nachhaltigkeitsrisiken in die tatsächlichen Investitionsentscheidungen soll sicherstellen, dass Nachhaltigkeitsrisiken in ähnlicher Weise berücksichtigt werden wie alle anderen Risiken, die in den Investitionsentscheidungsprozess integriert sind.

**Beschränkungen hinsichtlich der Methode und Daten**– Die Bewertung von Nachhaltigkeitsrisiken ist komplex, und sie kann auf ESG-Daten basieren, die von externen Datenanbietern auf der Grundlage ihrer eigenen Methodik zur Verfügung gestellt werden. ESG-Daten, einschließlich Ratings, sind unter Umständen nicht genau, vollständig, aktuell und/oder kontinuierlich verfügbar und für bestimmte Emittenten möglicherweise schwer zu beschaffen, was vom Grad der Transparenz des Emittenten und der öffentlich zugänglichen Informationen abhängt.

**Sorgfaltspflicht und Einflussnahme**– Jede Anlage, die für eine Investition in Frage kommt, wird zunächst von den Analysten im Fondsresearch des Anlageverwalters einer Sorgfaltsprüfung unterzogen. Aus dieser resultiert eine Kaufliste der genehmigten Fonds, die alle Anlageklassen, Regionen und spezifischen Themen abdeckt. Der Anlageverwalter nutzt diese Kauflisten, um dann nach eigenem Ermessen die einzelnen Anlagen für die Fondsinvestitionen auszuwählen. Dabei wendet er denselben Prozess und dieselbe Methodik wie bei allen Investitionen und der Wertpapierauswahl an, um ein Engagement in den verschiedenen Anlageklassen aufzubauen, die Teil der taktischen Vermögensallokation des Fonds sind.

**Auswirkungen von Nachhaltigkeitsrisiken auf die Fondsrenditen** – Nachhaltigkeitsrisikofaktoren sind im Allgemeinen mittel- bis langfristige Anlagerisiken, die auch kurzfristig auftreten können. Sie können in jeder der drei Dimensionen Gestalt annehmen, und zwar als ökologische Risiken, soziale Risiken und/oder Unternehmensführungsrisiken. Beispielsweise können sich Nachhaltigkeitsrisiken als emittentenspezifische extreme Verlustrisiken manifestieren. Solche emittentenspezifischen Nachhaltigkeitsrisiken treten für gewöhnlich mit geringer Häufigkeit und Wahrscheinlichkeit auf, doch können sie hohe finanzielle Auswirkungen haben und zu erheblichen finanziellen Verlusten für den Fonds führen. Der Anlageverwalter ist sich bewusst, dass sich die Position des Fonds gegenüber Nachhaltigkeitsrisiken im Laufe der Zeit entwickelt, und wird den Grad der Gefährdung durch solche Risiken für den Fonds ständig überwachen.

**Wichtigste nachhaltige Auswirkungen (PAIs)** – Der Anlageverwalter und der Manager werden die potenziellen negativen Auswirkungen von Anlageentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren für diesen Fonds derzeit nicht berücksichtigen. Da der Fonds weder ökologische oder soziale Merkmale bewirbt noch nachhaltige Anlagen als Ziel hat, wurde beschlossen, dass weder der Anlageverwalter noch der Manager versuchen wird, solche nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu messen.

**Referenzwert** –Der Fonds wird vom Anlageverwalter aktiv gemanagt und nicht durch die Bezugnahme auf einen Index eingeschränkt.. *Der Fonds greift auf einen Referenzwert, den MSCI Switzerland Net Total Return Local Index* ausschließlich für die Zwecke des Performancevergleichs zurück, und der Anlageverwalter verfügt über einen breiten Ermessensspielraum, um von den Komponenten, Gewichtungen und Risikomerkmalen im Referenzwert unter Einhaltung der Ziele und Anlagepolitik des Fonds abzuweichen. Wie sehr der Fonds dem Referenzwert in Bezug auf dessen Zusammensetzung und Risikomerkmale ähnelt, wird im Laufe der Zeit Schwankungen unterworfen sein, und die Performance des Fonds kann sich mehr oder weniger deutlich von derjenigen des Referenzwerts unterscheiden.

*Weitere Informationen zur Anlagestrategie, die der Anlageverwalter anwendet, um das nachhaltige Anlageziel des Fonds zu erreichen, finden Sie unter - https://www.threerockcapital.com/sfdr-disclosure/*