Nachhaltigkeits-bezogene Offenlegung auf der Website

Für Finanzprodukte gemäss Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088

GKB (LU) Wandelanleihen Global ESG

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300H11BJOWS5ZMH69

Version: Januar 2024

Graubündner Kantonalbank

Verwaltungsgesellschaft:
Swisscanto Asset Management International S.A.
6, route de Trèves, L-2633 Senningerberg

Asset Management:
Graubündner Kantonalbank
Postfach, CH-7001 Chur, Schweiz

Zusammenfassung

1. Kein nachhaltiges Investitionsziel

Dieser Teilfonds verfolgt kein nachhaltiges Anlageziel. Mit diesem Teilfonds werden ökologische oder soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen angestrebt.

Bei diesem Teilfonds werden nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Principal Adverse Impacts) berücksichtigt. Zu diesem Zweck werden die obligatorischen Indikatoren aus Anhang 1 der Verordnung (EU) 2019/2088 zugrunde gelegt. Die PAIs werden (teilweise) im Anlageprozess bei den Ausschlusskriterien sowie bei der ESG-Integration und direkt über die Berechnung eines PAI-Scores berücksichtigt. Die Information bzgl. der PAIs aus Artikel 11(2) der Verordnung (EU) 2019/2088 werden im Jahresbericht veröffentlicht.

2. Ökologische oder soziale Merkmale des Finanzprodukts

Der Teilfonds verfolgt eine Anlagestrategie unter Berücksichtigung von ökologischen und sozialen Merkmalen eines Unternehmens. Die Identifizierung dieser Merkmale erfolgt mittels folgender Nachhaltigkeitsansätze:

☒ Ausschlusskriterien	☒ ESG-Integration

3. Anlagestrategie

Das Anlageziel dieses Teilfonds besteht hauptsächlich im Erreichen eines hohen und stetigen Ertrages unter Berücksichtigung des Aspektes der Risikoverteilung und der Sicherheit des Kapitals. Um dieses Ziel zu erreichen, wird beabsichtigt, das Gesamtvermögen des Teilfonds weltweit nach dem Grundsatz der Risikoverteilung in Wandelanleihen, Wandelnotes, Optionsanleihen und ähnlichen Wandel- und Optionsrechten auf Aktien anzulegen. Der Teilfonds kann Derivate zur Währungsabsicherung einsetzen.

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und investiert weltweit in rund 100 Emittenten. Der Teilfonds verpflichtet sich, nicht in Emittenten von Wandelanleihen, Wandelnotes, Optionsanleihen und ähnlichen Wandel- und Optionsrechten auf Aktien zu investieren, die an bestimmten ausgeschlossenen Aktivitäten beteiligt sind. Im Weiteren wird bei der Anlageanalyse eine gute Unternehmensführung berücksichtigt, indem die Einhaltung globaler Normen überprüft wird.

4. Aufteilung der Investitionen

Das Asset Management stellt sicher, dass mindestens 67% des Nettovermögens des Teilfonds entsprechend den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen verfolgt. Der Asset Manager behält sich im Umfang von höchstens 33% des Nettovermögens des Teilfonds vor, auch in andere Vermögenswerte zu investieren, die keine ökologischen und/oder sozialen Merkmale verfolgen.

5. Überwachung der ökologischen oder sozialen Merkmale

Es wird eine Vielzahl von Indikatoren herangezogen, um die Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale, die durch den Teilfonds beworben werden, zu messen.

Nachfolgende in die Anlageprozesse integrierte Nachhaltigkeitsansätze werden zur Bemessung des Erreichens der beworbenen Merkmale herangezogen:

☒ Ausschlusskriterien	☒ ESG-Integration

6. Methoden für ökologische oder soziale Merkmale

Das Asset Management nutzt eine Vielzahl von Datenpunkten, um die Bemessung der beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale durchzuführen.

Nachfolgende in die Anlageprozesse integrierte Nachhaltigkeitsindikatoren werden zur Bemessung des Erreichens der beworbenen Merkmale herangezogen:

☒ Ausschlusskriterien	Anhand von Ausschlusskriterien identifiziert das Asset Management ein erhöhtes Risiko der Verletzung von ökologischen und sozialen Werten. Gleichzeitig bedient es sich dieser Ausschlusskriterien, um ein Anlageuniversum zu erstellen, welches gezielter auf Anlagen ausgerichtet ist, die in Einklang mit diesen Werten stehen.
☒ ESG-Integration	Mit der Absicht, Chancen und Risiken vor dem Anlageentscheid zu erkennen, integriert das Asset Management ökologische (E), soziale (S) und Governance (G) Faktoren von Unternehmungen in den Anlageprozess (ESG-Integration).

7. Datenquellen und –verarbeitung

Das Asset Management verwendet ausschliesslich Daten des Anbieters MSCI ESG Research LLC.

8. Beschränkungen hinsichtlich der Methoden und Daten

Die ESG-Analyse des Asset Managements stützt sich auf Methoden und Daten, die vom externen Datenanbieter MSCI ESG Research LLC zur Verfügung gestellt werden. Diese können unvollständig, unrichtig, unterschiedlich oder nicht verfügbar sein. Die Beschränkungen hinsichtlich der Methoden und Daten bestehen in folgenden Bereichen: Bei der Festlegung und Anwendung von Ausschlusskriterien und bei der Umsetzung der ESG-Integration.

9. Sorgfaltspflichten

Verschiedene Verfahren werden angewendet, um die Sorgfaltspflichten in Bezug auf die getätigten und zu tätigenden Investitionen einzuhalten, z.B. klare Verantwortlichkeiten bei der Entwicklung der Nachhaltigkeitspolitik, Kontrollprozesse beim Asset Management, Risikomanagementprozesse sowie regelmässige Überprüfung des externen Datenanbieters.

10. Mitwirkungspolitik

Die Mitwirkungspolitik des Teilfonds deckt folgende Bereiche ab:

☐ Engagement	☐ Stimmrechtswahrnehmung

11. Bestimmter Referenzindex

Es wird kein nachhaltiger Referenzindex eingesetzt.