

Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungen

gem. Art. 10 der Verordnung (EU) 2019/2088 iVm Art. 23 bis 36 der Delegierten
Verordnung (EU) 2022/1288

Stiftungsfonds STS

Stand 01.01.2026

ampega.
Talanx Investment Group

Inhaltsverzeichnis

Stiftungsfonds STS

Zusammenfassung	3
Kein nachhaltiges Investitionsziel	4
Ökologische oder soziale Merkmale des Finanzprodukts	4
Anlagestrategie	4
Aufteilung der Investitionen	5
Überwachung der ökologischen oder sozialen Merkmale	6
Methoden	6
Datenquellen und -verarbeitung	6
Beschränkungen hinsichtlich der Methoden und Daten	6
Sorgfaltspflicht	7
Mitwirkungspolitik	7
Bestimmter Referenzwert	7
Änderungsverzeichnis	7

Zusammenfassung

Der aktiv verwaltete Fonds STS ist ein Investmentvermögen gemäß der OGAW-Richtlinie. Ziel des Fondsmanagements ist es, unter Berücksichtigung der eingegangenen Risiken und der Entwicklung der Kapitalmärkte bei Kapitalerhalt ausschüttbare Erträge zu erwirtschaften und langfristig eine attraktive Wertentwicklung zu erzielen. Grundsätzlich müssen die erworbenen Wertpapiere auf EUR lauten und die Rententitel und Geldmarktinstrumente mindestens über ein Rating im Bereich des Investment-Grade einer anerkannten Rating-Agentur verfügen. Unter Nachhaltigkeit wird unter anderem das Streben nach langfristigem wirtschaftlichem Erfolg unter gleichzeitiger Berücksichtigung ökologischer, sozialer und ethischer Grundsätze oder den Grundsätzen internationaler und nationaler Standards guter und verantwortungsvoller Unternehmensführung verstanden. Der Portfoliomanager stützt seine ESG-Analyse auf einen Best-in-Class-Ansatz („ESG Best-in-Class“).

Der Stiftungsfonds STS ist ein Finanzprodukt, mit dem ökologische und soziale Merkmale beworben werden und qualifiziert gemäß Artikel 8 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2019/2088 („Offenlegungsverordnung“).

Mit diesem Finanzprodukt werden ökologische oder soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen angestrebt.

Bei der Auswahl der Vermögensgegenstände werden neben dem finanziellen Erfolg ökologische und soziale Merkmale berücksichtigt.

Der Fonds sieht vor, zu einem überwiegenden Teil in Vermögensgegenstände zu investieren, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale beitragen.

Die Gesellschaft hat ein Vorgehen für ein ESG-Screening erarbeitet und implementiert. Bei Wertpapierkäufen wird über das Limitcontrolling geprüft, ob der Emittent des Wertpapiers die ESG-Ausschlusskriterien verletzt. Darüber hinaus sind bei der Bewertung einzelner Finanzprodukte auch externe Bewertungen als Feedback relevant.

Die Gesellschaft verwendet verschiedene Nachhaltigkeitsindikatoren, um die Erreichung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale des Fonds zu messen.

Die Bewertung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale der Investitionen basiert auf Informationen von spezialisierten externen Datenanbietern, wie bspw. Sustainalytics und ISS-ESG, sowie auf eigenen Analysen, die von internen Analysten durchgeführt werden. Die Vorgaben werden in den im Investmentprozess genutzten Tools integriert, welche auch zur Überwachung der Restriktionen des Anlageuniversums verwendet werden.

Bei Unklarheiten oder fehlenden Informationen zu Nachhaltigkeitsindikatoren strebt die Gesellschaft einen aktiven Austausch mit den Datenprovidern an. Darüber hinaus kann in diesen Fällen alternativ auf eigene Analysen zurückgegriffen werden. Durch die beschriebenen Möglichkeiten bzw. Maßnahmen kann trotz der Beschränkungen erreicht werden, dass die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt werden.

Die Gesellschaft gestaltet ihre Prozesse entsprechend ihrem Verständnis von verantwortlichem Investieren. Es werden eigenverantwortliche Vorkehrungen getroffen, die in unterschiedlichen Standards verankerte Prinzipien zum verantwortlichen Investieren in den Investmentprozessen in angemessenem Umfang einbeziehen.

Die Gesellschaft hat Nachhaltigkeitsfaktoren auch in den Engagement Prozess integriert und nimmt so Einfluss auf die Unternehmensführung sowie die Ausrichtung der investierten Unternehmen.

Für dieses Finanzprodukt wurde kein Index als Referenzwert für die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bestimmt.

Kein nachhaltiges Investitionsziel

Mit diesem Finanzprodukt werden ökologische oder soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen angestrebt.

Ökologische oder soziale Merkmale des Finanzprodukts

Bei der Auswahl der Vermögensgegenstände werden neben dem finanziellen Erfolg beispielsweise folgende ökologischen und sozialen-Merkmale berücksichtigt

- Umwelt („Environmental“): Vermeidung von Klimatransitionsrisiken, Erhaltung von Flora und Fauna, Schutz der natürlichen Ressourcen und der Atmosphäre, Begrenzung der Bodenverschlechterung und des Klimawandels, Vermeidung von Eingriffen in Ökosysteme und Verlusten der biologischen Vielfalt.
- Soziales („Social“): Allgemeine Menschenrechte, Verbot von Kinder- und Zwangsarbeit, Einhaltung der Gleichbehandlungsgrundsätze, Faire Arbeitsbedingungen und angemessene Entlohnung.
- Unternehmensleitsätze („Governance“): Einhaltung von Unternehmensethik und Prinzipien der Korruptionsbekämpfung gemäß UN Global Compact, Leitsätze der guten Unternehmensführung sowie Regelungen zur Verhinderung der Geldwäsche und Terrorismusfinanzierung.

Anlagestrategie

Der aktiv verwaltete Fonds Stiftungsfonds STS ist ein Investmentvermögen gemäß der OGAW-Richtlinie. Ziel des Fondsmanagements ist es, unter Berücksichtigung der eingegangenen Risiken und der Entwicklung der Kapitalmärkte bei Kapitalerhalt ausschüttbare Erträge zu erwirtschaften und langfristig eine attraktive Wertentwicklung zu erzielen. Grundsätzlich müssen die erworbenen Wertpapiere auf EUR lauten und die Rententitel und Geldmarktinstrumente mindestens über ein Rating im Bereich des Investment-Grade einer anerkannten Rating-Agentur verfügen. Unter Nachhaltigkeit wird unter anderem das Streben nach langfristigem wirtschaftlichem Erfolg unter gleichzeitiger Berücksichtigung ökologischer, sozialer und ethischer Grundsätze oder den Grundsätzen internationaler und nationaler Standards guter und verantwortungsvoller Unternehmensführung verstanden. Der Portfoliomanager bezieht im Rahmen seines Investmentprozesses alle relevanten finanziellen Risiken in ihre Anlageentscheidung mit ein und bewertet diese fortlaufend.

Dabei werden auch alle relevanten Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die wesentliche negative Auswirkungen auf die Rendite einer Investition haben können, sowie die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen einer Anlageentscheidung auf Nachhaltigkeitsfaktoren. Unter Nachhaltigkeitsfaktoren werden dabei Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte und die Bekämpfung von Korruption und Bestechung verstanden.

Der Portfoliomanager stützt seine ESG-Analyse auf einen Best-in-Class-Ansatz („ESG Best-in-Class“). Jeder Emittent wird mit einer quantitativen Punktzahl bewertet, die um den Durchschnitt seines Sektors herum skaliert ist und es ermöglicht, die besten von den schlechtesten auf Sektor Ebene zu unterscheiden. Die Bewertung basiert auf einer Kombination aus extrafinanziellen Daten von Drittanbietern und einer qualitativen Analyse der zugehörigen Sektor- und Nachhaltigkeitsthemen. Die quantitative Bewertung wird in eine Ratingskala übersetzt, die von A für beste Praktiken, bis G für die schlechtesten Praktiken reicht. Bei dem „ESG Best-in-Class A-D“ wird nur in Finanzinstrumente investiert, welche in der Ratingskala A-D eingestuft sind.

Der Portfoliomanager wird gegenüber dem Sondervermögen Stiftungsfonds STS im Sinne eines Nachhaltigkeitsansatzes (ESG-Kriterien: „Best-in-Class A-D) eine Negativliste berücksichtigen. Basierend auf einem vom Portfoliomanager festgelegten Anlageuniversum, werden Ausschlusskriterien geprüft und daraus monatlich eine Negativliste für Renten- und Aktieninvestments erstellt. Diese Negativliste umfasst Emittenten, welche die nachfolgenden verbindlichen Elemente der Anlagestrategie, die für die Auswahl der Investitionen zur Erfüllung der beworbenen ökologischen oder sozialen Ziele verwendet werden, verletzen. Das erwerbbare Anlageuniversum wird auf monatlicher Basis überprüft und entsprechend bei Veränderungen angepasst und im EDV-System hinterlegt. Damit ist zum einen gewährleistet, dass bei jedem Kauf der Emittent auf die nachfolgenden verbindlichen Elemente der Anlagestrategie, die für die Auswahl der Investitionen zur Erfüllung der beworbenen ökologischen oder sozialen Ziele verwendet werden, überprüft werden. Zum anderen werden die im Bestand befindlichen Emittenten ebenfalls auf einer monatlichen Basis auf die Einhaltung der Merkmale nach dem Vieraugenprinzip geprüft.

Aufteilung der Investitionen

Die Vermögensgegenstände des Fonds werden in nachstehender Grafik in verschiedene Kategorien unterteilt. Mit „Investitionen“ werden alle für den Fonds erwerbbaren Vermögensgegenstände erfasst.

Die Kategorie „#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale“ umfasst diejenigen Vermögensgegenstände, die im Rahmen der Anlagestrategie zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigten werden. Der Mindestanteil der Investitionen, die zur Erfüllung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erfolgen, beträgt 51 %.

Die Kategorie „#2 Andere Investitionen“ umfasst z. B. Derivate, Bankguthaben oder Finanzinstrumente, für die nicht genü-

gend Daten vorliegen, um sie für die nachhaltige Anlagestrategie des Fonds bewerten zu können. Bis zu 49 % der Investitionen können der Kategorie „#2 Andere Investitionen“ entsprechen. Die Kategorie „#1A Nachhaltige Investitionen“ umfasst nachhaltige Investitionen gemäß Artikel 2 Ziffer 17 der Offenlegungsverordnung. Dies beinhaltet Investitionen, mit denen „Taxonomiekonforme“ Umweltziele, „Andere ökologische“ und soziale Ziele („Soziale“) angestrebt werden können. Mindestens 0 % werden in nachhaltige Investitionen angelegt (Kategorie „#1A Nachhaltige Investitionen“). Die Kategorie „#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ umfasst Investitionen, die zwar auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet sind, sich aber nicht als nachhaltige Investition qualifizieren.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigten wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst folgende Unterkategorie:

- Die Unterkategorie #1B Andere ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Überwachung der ökologischen oder sozialen Merkmale

Bei Wertpapierkäufen wird über das Limitcontrolling geprüft, ob der Emittent des Wertpapiers die ESG-Ausschlusskriterien verletzt. Auf täglicher Basis wird zudem ein ESG-Screening des Bestands durchgeführt. Darüber hinaus sind bei der Bewertung einzelner Finanzprodukte auch externe Bewertungen als Feedback relevant. Maßgeblich für die Umsetzung der hier genannten Ausschlusskriterien sind die verfügbaren Informationen von ESG Datenanbietern. Anlassbezogen werden eigene ESG Bewertungen für einzelne Emittenten durchgeführt.

Die Nachhaltigkeitsindikatoren werden aus den für den Fonds verbindlichen Elementen abgeleitet. Diese verbindlichen Elemente werden innerhalb der Systeme überwacht. Sofern Verstöße auftreten, werden diese an die zuständigen Einheiten gemeldet und auf der Grundlage interner Verfahren gelöst.

Methoden

Die Gesellschaft verwendet verschiedene Nachhaltigkeitsindikatoren, um die Erreichung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale des Fonds zu messen. Hierzu zählen:

– Ausschlusskriterien:

Für den Bestand des Fonds wurde ein grundsätzlicher Filterkatalog entwickelt, welcher auf alle getätigten Investitionen angewendet wird. Dieser beinhaltet mitunter den Ausschluss kontroverser Waffenhersteller oder die Berücksichtigung der UN Global Compact Kriterien. Durch diesen Ansatz werden Investitionen im Rahmen der Allokationsentscheidung in Bezug auf Nachhaltigkeitsrisiken bewertet und berücksichtigt. Das zulässige Investmentuniversum wird hierdurch definiert und Investitionen mit hohem Nachhaltigkeitsrisiko werden begrenzt.

– Nachhaltigkeitsindikatoren:

Die Auswahl der Vermögensgegenstände erfolgt unter der Verwendung einer eigenentwickelten maßgeschneiderten quantitativen Nachhaltigkeitsbewertung auf Grundlage mehrerer ESG Daten-Quellen.

Im Rahmen der Environmental-Social-Governance-Analyse zur Bestimmung der nachhaltigsten Unternehmen in unterschiedlichen Wirtschaftszweigen werden unter anderem verschiedene Indikatoren externer Datenanbieter herangezogen, beispielsweise: ESG-Leistung eines Unternehmens, Ausmaß der branchenspezifischen E-, S- und G-

Risiken und Auswirkungen, Nachhaltigkeits-Chancen, Nachhaltigkeits-Risiken und Governance, ESG-Risiko-Rating, Umweltperformance, Ressourcenschonung, Einhaltung der Menschenrechte, Management der Lieferkette.

Datenquellen und -verarbeitung

Die Bewertung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale basiert auf Informationen von spezialisierten externen Datenanbietern, wie bspw. Sustainalytics und ISS-ESG, sowie auf eigenen Analysen, die von internen Analysten durchgeführt werden. Die Vorgaben werden in den im Investmentprozess genutzten Tools integriert, welche auch zur Überwachung der Restriktionen des Anlageuniversums verwendet werden.

Die Zusammensetzung des Portfolios sowie die ESG-Scores, Ausschlüsse und sonstiger Nachhaltigkeitsfaktoren der zugrundeliegenden Vermögenswerte werden sowohl bei der Investitionsentscheidung als auch kontinuierlich überprüft. Es wird täglich eine vollständige Überprüfung der getätigten Investitionen auf Einhaltung der festgesetzten Nachhaltigkeitsfaktoren mit Unterstützung externer Datenanbieter durchgeführt.

Die Datenanbieter informieren zusätzlich zu den bezogenen Rohdaten regelmäßig per E-Mail über Veränderungen der Nachhaltigkeitsfaktoren, vor allem der ESG-Scores von Emittenten.

Es werden keine Daten geschätzt.

Beschränkungen hinsichtlich der Methoden und Daten

Für die Bewertung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden unterschiedliche Datenquellen und Methoden verwendet. Dabei besteht die Möglichkeit, dass Informationen und Daten nur unvollständig, ungenau oder nicht verfügbar sein können. Dies kann beispielsweise darauf zurückzuführen sein, dass derzeit nur bestimmte Unternehmen verpflichtet sind Angaben über Nachhaltigkeitsindikatoren zu veröffentlichen.

Bei Unklarheiten oder fehlenden Informationen zu Nachhaltigkeitsindikatoren strebt die Gesellschaft einen aktiven Austausch mit den Datenprovidern an. Darüber hinaus kann in diesen Fällen alternativ auf eigene Analysen zurückgegriffen werden.

Durch die beschriebenen Möglichkeiten bzw. Maßnahmen kann trotz der Beschränkungen erreicht werden, dass die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt werden.

Sorgfaltspflicht

Die Gesellschaft gestaltet ihre Prozesse entsprechend ihrem Verständnis von verantwortlichem Investieren. Es werden eigenverantwortliche Vorkehrungen getroffen, die in unterschiedlichen Standards verankerte Prinzipien zum verantwortlichen Investieren in den Investmentprozessen in angemessenem Umfang einbeziehen.

Die Gesellschaft ist Unterzeichner der Principles for Responsible Investment (PRI) und verpflichtet sich damit zum Ausbau nachhaltiger Geldanlagen und zur Einhaltung der sechs durch die UN aufgestellten Prinzipien für verantwortliches Investieren. Überdies unterstützt die Gesellschaft den UN Global Compact, die weltweit größte Initiative für verantwortliche Unternehmensführung.

Als Vollmitglied des Bundesverbandes Investment und Asset Management e.V. („BVI“) orientiert sich die Gesellschaft an den Wohlverhaltensregeln des BVI und übernimmt gesellschaftliche Verantwortung in ökologischen, sozialen Belangen sowie zur guten Unternehmensführung.

Die Auswahl und laufende Überwachung der Vermögensgegenstände für den Fonds orientiert sich dabei am Verkaufsprospekt, sowie den Allgemeinen und besonderen Anlagebedingungen des Fonds. Dabei beachtet die Gesellschaft die Vorgaben des Kapitalanlagegesetzbuchs („KAGB“) sowie der Richtlinie über die Verwalter alternativer Investmentfonds („AIFMD“ – Directive on Alternative Investment Funds Managers).

Mitwirkungspolitik

Die Gesellschaft hat Nachhaltigkeitsfaktoren auch in den Engagement Prozess integriert und nimmt so Einfluss auf die Unternehmensführung sowie die Ausrichtung der investierten Unternehmen. Bei der Stimmrechtsausübung werden die in der Anlagestrategie festgelegten Ziele verfolgt und bei Beschlussvorschlägen für Hauptversammlungen eingebracht. Für die Analyse der Unterlagen für die Hauptversammlungen wird ebenfalls auf externe und spezialisierte Datenanbieter (bspw. ISS-ESG) zurückgegriffen, um Nachhaltigkeitsfaktoren

in das Abstimmungsverhalten mit einfließen zu lassen. Die Mitwirkungspolitik (Engagement Policy) der Gesellschaft ist unter nachfolgendem Link zu finden: [Informationen zur Nachhaltigkeit](#).

Bestimmter Referenzwert

Für dieses Finanzprodukt wurde kein Index als Referenzwert für die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bestimmt.

Änderungsverzeichnis

Datum	Änderung
01.01.2026	Redaktionelle Anpassung
01.12.2023	Redaktionelle Anpassung
01.01.2023	Initiale Erstellung des Dokumentes aufgrund der Offenlegungsverordnung Level 2

Ampega Investment GmbH
Charles-de-Gaulle-Platz 1, 50679 Köln, Deutschland

Fon +49 (221) 790 799-0
Fax +49 (221) 790 799-999
Web www.ampega.com