

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:**  
ODDO BHF METROPOLE EURO SRI

**Unternehmenskennung (LEI-Code):**  
969500QQ9E15H1K817

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: K. A.

In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: K. A.

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von k. A. an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



## INWIEWEIT WURDEN DIE MIT DEM FINANZPRODUKT BEWORBENEN ÖKOLOGISCHEN UND/ODER SOZIALEN MERKMALE ERFÜLLT?

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Während des Zeitraums, auf den sich dieser Bericht bezieht, hat der Fonds seine ökologischen und sozialen Merkmale mithilfe folgender Maßnahmen erfüllt:

- Effektive Umsetzung der Ausschlusspolitik von ODDO BHF Asset Management (Kohle, Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC), unkonventionelles Erdöl und Erdgas, umstrittene Waffen, Tabak, Zerstörung der Biodiversität und Förderung fossiler Brennstoffe in der Arktis) sowie der fondsspezifischen Ausschlüsse.
- Einbeziehung von ESG-Ratings wie im Fondsprospekt (Anlagestrategie) beschrieben.
- Initiativen zum Dialog und zur Mitwirkung gemäß der Dialog- und Mitwirkungspolitik des Fondsmanagers.
- Berücksichtigung der wichtigsten negativen Auswirkungen gemäß der Politik des Fondsmanagers bezüglich Artikel 4 der Offenlegungsverordnung.

Die Berücksichtigung der Principal Adverse Impacts (PAI) für diesen Fonds beruht bei drei PAI (7, 10 und 14) auf einem Negativ-Screening und bei den anderen PAI auf ESG-Ratings, Dialog, Mitwirkung und Abstimmung, wie in der PAI-Politik beschrieben, die als Bestandteil der gesetzlich vorgeschriebenen Informationen auf der Website von ODDO BHF Asset Management verfügbar ist.

### ● *Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?*

29.12.2023		
	Fonds	Absicherung
Internes ESG-Rating*	AAA	100,0
Frauenquote im Verwaltungsrat (%)	41,0	100,0
Unabhängigkeit der Verwaltungsratsmitglieder (%)	65,4	100,0
Gewichtete CO <sub>2</sub> -Intensität (t CO <sub>2</sub> -Äquivalent / Mio. EUR Umsatz)	139,2	100,0
Nachhaltige Investitionen (%)	k.A.	k.A.
Taxonomiekonforme Investitionen (%)	k.A.	k.A.

\* Ein Rating von CCC beinhaltet das höchste Risiko, während AAA für das beste Rating steht.

### ● *... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?*

30.12.2022		
	Fonds	Absicherung
Internes ESG-Rating*	AAA	100,0
Frauenquote im Verwaltungsrat (%)	40,2	100,0
Unabhängigkeit der Verwaltungsratsmitglieder (%)	67,0	100,0
Gewichtete CO <sub>2</sub> -Intensität (t CO <sub>2</sub> -Äquivalent / Mio. EUR Umsatz)	229,0	97,0
Nachhaltige Investitionen (%)	0,0	0,0
Taxonomiekonforme Investitionen (%)	0,0	0,0

\* Ein Rating von CCC beinhaltet das höchste Risiko, während AAA für das beste Rating steht.

### ● *Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie hat die nachhaltige Investition zu diesen Zielen beigetragen?*

Der Fonds hatte keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der Fonds hatte keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel.

**Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Das Managementteam wendet vor dem Handel Regeln zu drei PAI an:

- Engagement in umstrittenen Waffen (PAI 14, Toleranz 0%)
- Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (PAI 7, Toleranz 0%),
- schwere Verstöße gegen die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen oder die Leitsätze für multinationale Unternehmen der Organisation für Entwicklung und Zusammenarbeit (OECD) (PAI 10, Toleranz 0%)

Außerdem bezieht das Managementteam noch weitere PAI in seine ESG-Analyse der Unternehmen mit ein, falls diesbezügliche Informationen verfügbar sind, wendet aber keine strikten Kontrollvorschriften an. Die Erhebung der PAI-Daten ermöglicht die endgültige Festlegung des ESG-Ratings. Bei den Daten kann es sich in erster Linie um veröffentlichte Daten und in geringerem Maße um Schätzungen handeln.

Die ESG-Analyse umfasst die Kontrolle der THG-Emissionen (PAI 1), die CO<sub>2</sub>-Intensität (PAI 3), den Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (PAI 5), die Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (PAI 6), fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (PAI 11) und das ausgewogene Geschlechterverhältnis in den Leitungs- und Kontrollorganen (PAI 13). Die Verwaltungsgesellschaft berücksichtigt gleichermaßen das Fehlen einer Menschenrechtspolitik (PAI 9).

**Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Der Fonds hatte keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Das DNSH-Prinzip gilt nur für die zugrunde liegenden Anlagen des Finanzprodukts, die den Kriterien der Europäischen Union für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten entsprechen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die **bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen** von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.



## WIE WURDEN BEI DIESEM FINANZPRODUKT DIE WICHTIGSTEN NACHTEILIGEN AUSWIRKUNGEN AUF NACHHALTIGKEITSAKTIVITÄTEN BERÜCKSICHTIGT?

Das Finanzprodukt berücksichtigt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen durch Ausschlüsse basierend auf Pre- und Post-Trade-Kontrollen, Dialog, Mitwirkung und ESG-Analysen.

Die Berücksichtigung der Principal Adverse Impacts (PAI) für diesen Fonds beruht bei drei PAI (Biodiversität, Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen sowie Bezug zu umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)) auf einem Negativ-Screening und bei den anderen PAI auf ESG-Ratings, Dialog, Mitwirkung und Abstimmung, wie in der PAI-Politik beschrieben, die als Bestandteil der gesetzlich vorgeschriebenen Informationen auf der Website von ODDO BHF Asset Management verfügbar ist.

PAI	29.12.23	Absicherung
1. Scope-1-Treibhausgasemissionen	16.239,7	95,6%
1. Scope-2-Treibhausgasemissionen	3.123,3	95,6%
1. Scope-Treibhausgasemissionen	88.216,8	95,6%
2. Treibhausgasemissionen insgesamt	107.122,3	95,6%
3. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck	891,3	95,6%
4. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird	904,6	95,6%
5. Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind	0,1	95,6%
6. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	0,7	82,0%
7. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	58,6	51,8%
8. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken	0,0	95,6%
9. Emissionen in Wasser	0,0	2,0%
10. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle	3,2	38,1%
11. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen	0,0	95,6%
12. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen	0,1	95,6%
13. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle	0,2	31,3%
14. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	0,4	95,6%
15. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	0,0	95,6%



## WAS WAREN DIE HAUPTINVESTITIONEN BEI DIESEM FINANZPRODUKT?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:  
01.01.2023 – 29.12.2023

Größte Investitionen	Sektor*	In % der Vermögenswerte**	Land
Axa Sa	Finanzbereich	4,1%	Frankreich
Banco Santander Sa	Finanzbereich	4,0%	Spanien
Sanofi	Gesundheitswesen	4,0%	Frankreich
Totalenergies SE	Energie	3,8%	Frankreich
Bnp Paribas	Finanzbereich	3,7%	Frankreich
Allianz Se-Reg	Finanzbereich	3,5%	Deutschland
Compagnie De Saint Gobain	Industrie	3,5%	Frankreich
Siemens Ag-Reg	Industrie	3,5%	Deutschland
Intesa Sanpaolo	Finanzbereich	3,2%	Italien
Anheuser-Busch Inbev Sa/Nv	Basiskonsumgüter	3,1%	Belgien
Ing Groep Nv	Finanzbereich	3,0%	Niederlande
Publicis Groupe	Telekommunikationsdienstleistungen	2,8%	Frankreich
Oddo Bhf Métropole Small Cap Value A	–	2,8%	Frankreich
Repsol SA	Energie	2,7%	Spanien

\* Zum 29.12.2023 betrug das Gesamtengagement des Fonds im Bereich fossiler Brennstoffe 0,0%, bei einer Abdeckung von 0,0%.

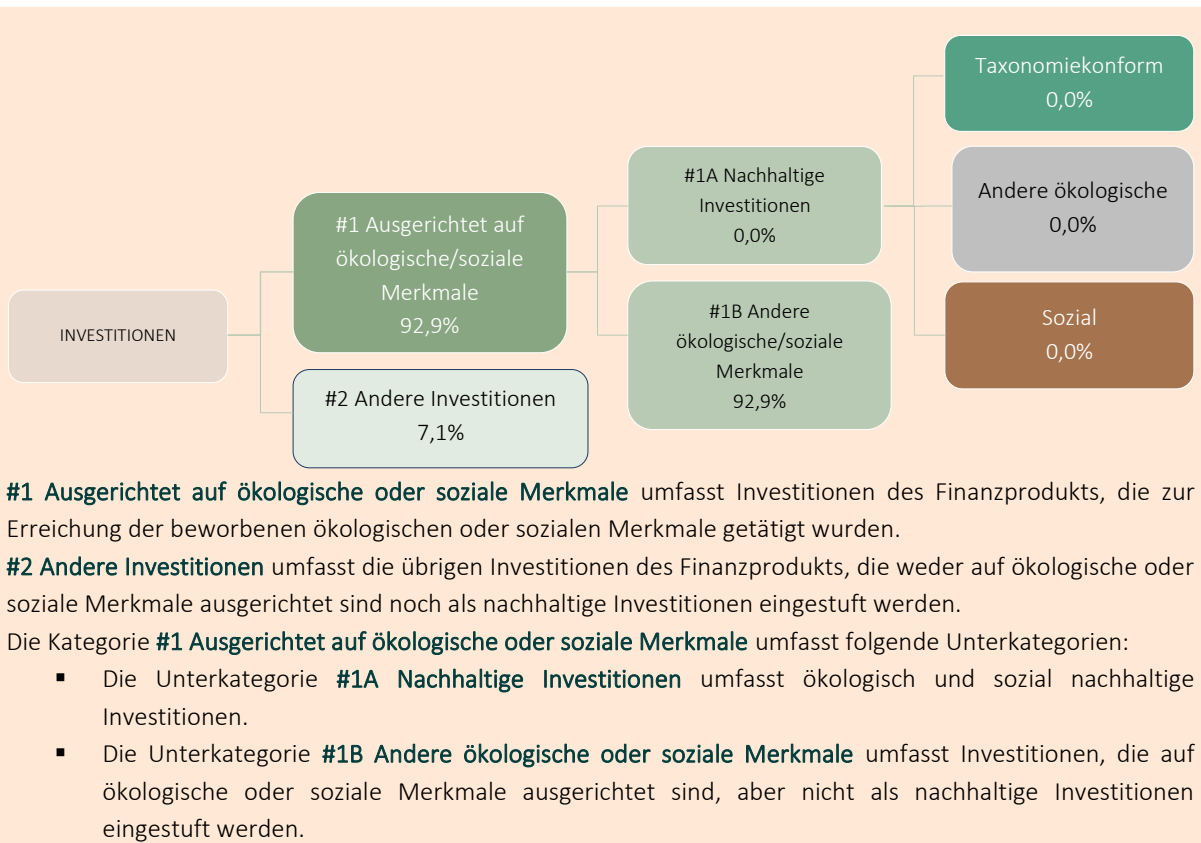
\*\* Berechnungsmethode: Durchschnitt der Investitionen basierend auf 4 Kontrollen, die das maßgebliche Geschäftsjahr abdecken (Intervall: gleitender Drei-Monats-Zeitraum).



## WIE HOCH WAR DER ANTEIL DER NACHHALTIGKEITSBEZOGENEN INVESTITIONEN?

Die Aufteilung ist in der nachfolgenden Grafik dargestellt.

### ● Wie sah die Vermögensallokation aus?



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

– **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln;

– **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

– **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die anderen Investitionen umfassen 4,3% Barmittel, 0,0% Derivate und 2,8% Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

### ● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Sektoren*	in % der Vermögenswerte zum 29.12.2023
Finanzbereich	24,8%
Industrie	13,7%
Nicht-Basiskonsumgüter	12,8%
Gesundheitswesen	10,4%
Werkstoffe	10,4%
Basiskonsumgüter	7,6%
Energie	6,0%
Informationstechnologie	4,8%
Telekommunikationsdienstleistungen	2,4%
Fonds	2,8%
Barbestände	4,3%

\* Zum 29.12.2023 betrug das Gesamtengagement des Fonds im Bereich fossiler Brennstoffe 0,0%, bei einer Abdeckung von 0,0%.



**Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?**

Der Fonds hatte keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel.

- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

Ja  In fossiles Gas  In Kernenergie

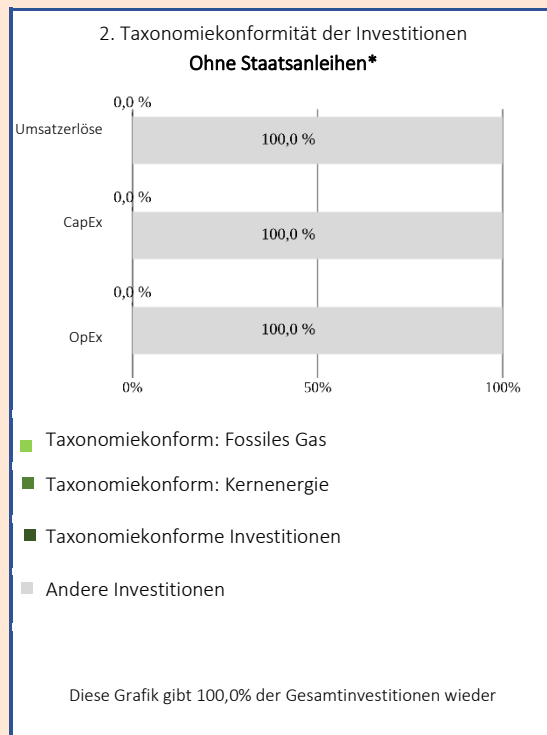
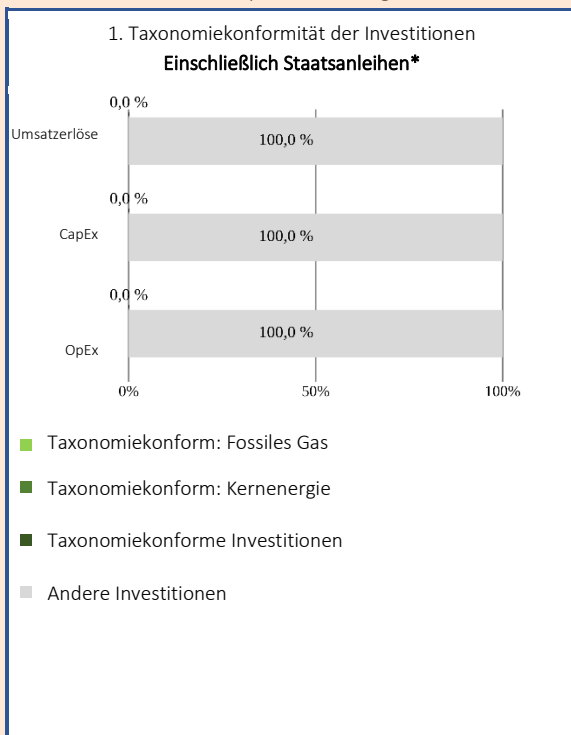
Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Übergangstätigkeiten** sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind, beträgt 0%.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht anwendbar

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



Sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



### Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Fonds hatte keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel.



### Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Es wurden keine sozial nachhaltigen Investitionen getätigt.



### Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zu den in „#2 Andere Investitionen“ enthaltenen Investitionen zählen Barmittel, Derivate und andere sekundäre Vermögenswerte, die ein optimales Portfoliomanagement ermöglichen.

Der Mindestschutz für Investitionen ohne ESG-Rating wird durch die Umsetzung der Ausschlusspolitik von ODDO BHF Asset Management und/oder die fondsspezifischen Ausschlüsse sichergestellt.

Angesichts der Rolle dieser Derivate haben sie sich unseres Erachtens nicht negativ auf die Fähigkeit des Fonds ausgewirkt, seine ökologischen und sozialen Merkmale zu erfüllen.



## WELCHE MAßNAHMEN WURDEN WÄHREND DES BEZUGSZEITRAUMS ZUR ERFÜLLUNG DER ÖKOLOGISCHEN UND/ODER SOZIALEN MERKMALE ERGRIFFEN?

Der Fondsmanager hat seine Strategie eines aktiven Aktionärstums anhand folgender Maßnahmen umgesetzt:

1. Abstimmung bei Jahreshauptversammlungen, sofern der Fonds die Anforderungen der Abstimmungspolitik des Fondsmanagers erfüllt.
2. Dialog mit den Unternehmen.
3. Initiativen zur Mitwirkung der Unternehmen gemäß der Mitwirkungspolitik des Fondsmanagers.
4. Umsetzung der Ausschlusspolitik von ODDO BHF Asset Management und der fondsspezifischen Ausschlüsse.
5. Berücksichtigung der PAI gemäß der PAI-Politik des Fondsmanagers.



## WIE HAT DIESES FINANZPRODUKT IM VERGLEICH ZUM BESTIMMTEN REFERENZWERT ABGESCHNITTEN?

Die allgemeine Performance können Sie der nachfolgenden Tabelle entnehmen.

### ● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Der Fonds misst seine ESG-Performance am ESG-Fonds des ODDO BHF Métropole Euro SRI, der alle Titel der Eurozone umfasst, deren Börsenkapitalisierung mehr als 4 Milliarden Euro beträgt, d. h. 288 Unternehmen per 29.12.2023.

### ● *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Die Referenzwerte sind nicht auf die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet, da sie vom Fondsmanager ausgeschlossene Unternehmen enthalten können. Darüber hinaus werden diese Referenzwerte nicht anhand von ökologischen oder sozialen Kriterien bestimmt.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.



● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Die allgemeine Performance können Sie der nachfolgenden Tabelle entnehmen.

29.12.2023				
	Fonds	Absicherung	ESG-Universum	Absicherung
Internes ESG-Rating	AAA	100,0	AA+	100,0
Frauenquote im Verwaltungsrat (%)	41,0	100,0	38,6	99,7
Unabhängigkeit der Verwaltungsratsmitglieder (%)	65,4	100,0	61,1	99,7
Gewichtete CO <sub>2</sub> -Intensität (t CO <sub>2</sub> -Äquivalent / Mio. EUR Umsatz)	139,2	100,0	107,2	100,0
Nachhaltige Investitionen (%)	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
Taxonomiekonforme Investitionen (%)	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht anwendbar