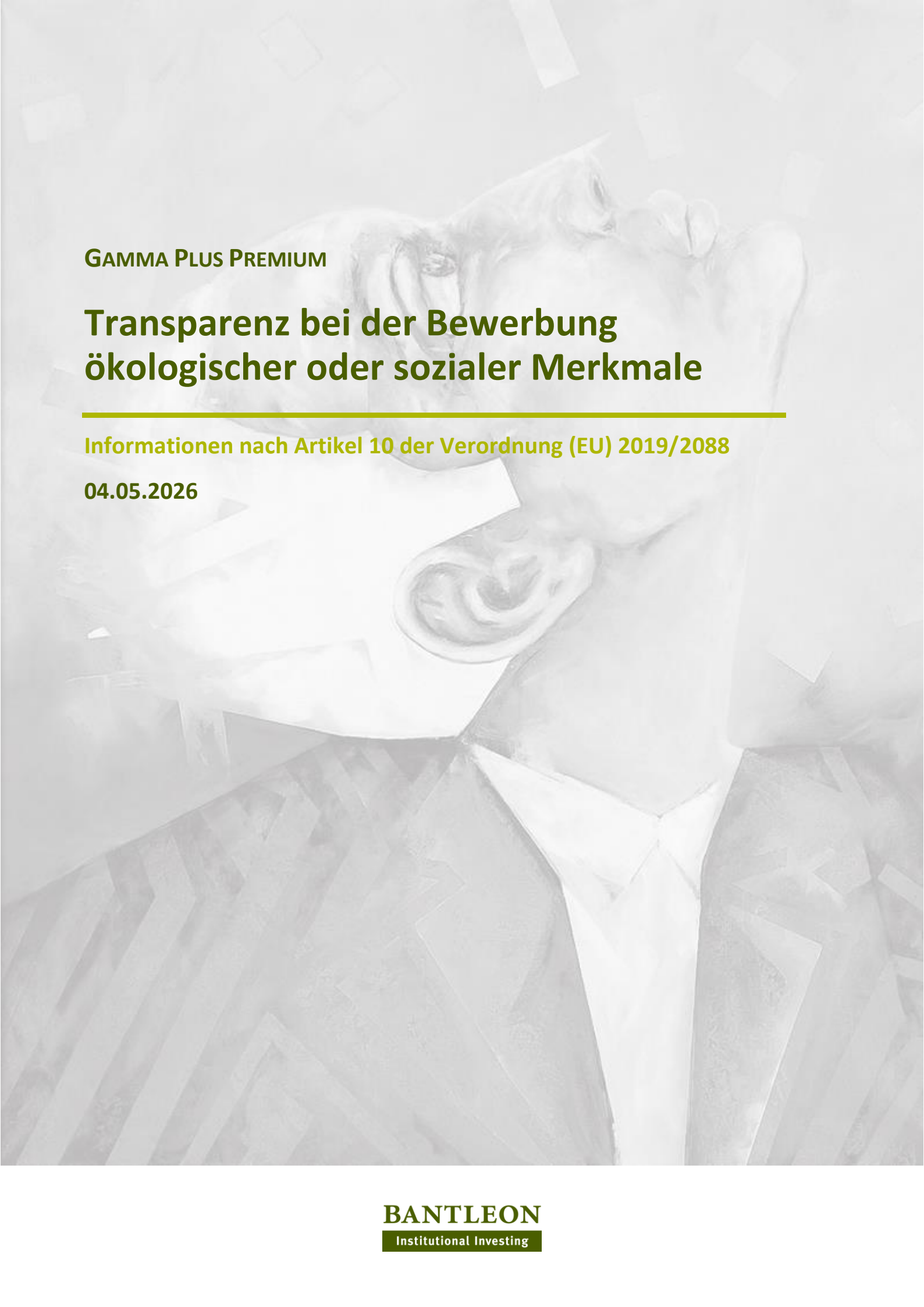




GAMMA PLUS PREMIUM

Transparenz bei der Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale

Informationen nach Artikel 10 der Verordnung (EU) 2019/2088

04.05.2026

Einleitung

Die BANTLEON Invest Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH legt in ihrer Rolle als Kapitalverwaltungsgesellschaft die nachfolgenden Informationen gemäß Artikel 10 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (»Offenlegungsverordnung«) offen. Die Informationen beziehen sich auf das Investmentvermögen Gamma Plus Premium.

Zusammenfassung

Der Fonds besteht aus einem Basisportfolio aus Anleihen und Fest- und Termingeldern sowie einem Derivate-Portfolio als hauptsächlichem Renditeträger. Das Derivate-Portfolio besteht überwiegend aus gekauften (Long) und verkauften (Short) Optionen auf nordamerikanische Aktienindizes. Merkmal der Anlagestrategie ist, dass stets versucht wird, mehr Long als Short Optionen im Portfolio zu halten, und dabei einen Prämienüberschuss zu erzielen. Um das Ziel der Prämieinnahme zu erreichen, folgt der Anlageprozess einem eigens dafür entwickelten quantitativen Konzept. Der gesamte Investmentprozess erfolgt regelbasiert. Die Umsetzung erfolgt diskretionär. Ziel des Prämienüberschusses ist es, einen mit der tatsächlichen Marktphase weitestgehend unkorrelierten Ertragsstrom zu generieren (Absolute Return-Gedanke). Ziel des Überhangs an Long Optionen ist es, bei starken Markteinbrüchen einen gewissen Schutz gegen Verluste im Fondswert anzustreben und darüber hinaus die Möglichkeit, bei Markteinbrüchen zusätzliche Erträge zu erwirtschaften. Des Weiteren wird aktives Risikomanagement betrieben, um das Risiko so gering wie möglich zu halten. Das Portfolio wird laufend gescreent und bewertet. Sobald die Risikokennziffern nicht mehr im Gleichgewicht sind, erfolgt ein regelbasierter Absicherungsmechanismus. Nähere Informationen zur Anlagestrategie und den Nachhaltigkeitskriterien können dem Verkaufsprospekt entnommen werden.

Kein nachhaltiges Investitionsziel

Mit diesem Finanzprodukt werden ökologische oder soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen im Sinne des Art. 2 Nr. 17 der Offenlegungsverordnung (SFDR) angestrebt.

Ökologische oder soziale Merkmale des Finanzprodukts

Mit dem Fonds werden ökologische und soziale Merkmale im Bereich des Klimaschutzes (Environment – „E“), sozialer Normen (Social – „S“) sowie der verantwortungsvollen Unternehmensführung (Governance – „G“) beworben. Da sowohl in Staatsanleihen als auch in Unternehmen investiert werden kann, existieren jeweils spezifische Ausschlusskriterien. Dabei wendet der Fonds die folgenden ESG-bezogenen Ausschlusskriterien für Vermögensgegenstände (exklusive Bankguthaben und Derivate) an:

1. Ausschlusskriterien:

a) Generell ausgeschlossen sind Unternehmen,

- Die im Bereich kontroverser Waffen tätig sind. Dabei handelt es sich um Emittenten, die die folgenden international geächtete Produkte herstellen oder sich mit folgenden Vorwürfen konfrontiert sehen:
 - Produktion von Streubomben (Production of cluster munitions)
 - Produktion von Anti-Personen-Minen
 - Produktion biologischer und chemischer Waffen
 - Produktion von abgereicherten Uranwaffen beziehungsweise Uranmunition
 - Produktion von Brandbomben auf Basis von weißem Phosphor
 - Produktion von Brandwaffen
 - Produktion von Blendlaser
 - Produktion von nicht aufspürbaren Splintern

b) Zudem werden Unternehmen ausgeschlossen,

- die 5% oder mehr ihres Umsatzes mit der Tabakproduktion oder Herstellung von Tabakerzeugnissen erzielen,
- die 30% oder mehr ihres Umsatzes im Bereich Herstellung und/oder Vertrieb von Kohle erzielen,
- welche gegen die zehn Prinzipien des UN Global Compact verstoßen.

2. Ausschlusskriterien betreffend Staaten

Generell ausgeschlossen werden Staaten,

- die aufgrund des aktuell gültigen Freedom House Ranking als „nicht frei“ eingestuft werden.

3. Einbeziehung des ESG-Profiles

Der Fonds investiert innerhalb der in den Besonderen Anlagebedingungen definierten Anlagegrenzen in Emittenten (exklusive Bankguthaben und Derivate), die von einem durch die Gesellschaft anerkannten Anbieter für Nachhaltigkeits-Research unter ökologischen, sozialen und unternehmensführungsbezogenen Kriterien positiv bewertet worden sind. Alle entsprechenden Bewertungen bezieht die Gesellschaft hierbei von dem renommierten Datenanbieter ISS Stoxx.

Als positiv bewertet gelten Emittenten, die einen Mindestwert auf der Ratingskala (ESG Performance Score von ISS Stoxx) von 0 (schlechtestmögliche Bewertung) bis 100 (bestmögliche Bewertung) aufweisen. Der Fonds investiert in Emittenten, welche einen Score von 30 oder höher auf der genannten Skala aufweisen. Ein Referenzwert zur Erreichung der durch den Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurde nicht bestimmt.

Anlagestrategie

Der Fonds besteht aus einem Basisportfolio aus Anleihen und Fest- und Termingeldern sowie einem Derivate-Portfolio als hauptsächlichem Renditeträger. Das Derivate-Portfolio besteht überwiegend aus gekauften (Long-) und verkauften (Short-) Optionen auf nordamerikanische Aktienindizes. Merkmal der Anlagestrategie ist, dass stets versucht wird, mehr Long- als Short-Optionen im Portfolio zu halten, und dabei einen Prämienüberschuss zu erzielen. Um das Ziel der Prämieinnahme zu erreichen, folgt der Anlageprozess einem eigens dafür entwickelten quantitativen Konzept. Der gesamte Investmentprozess erfolgt regelbasiert. Die Umsetzung erfolgt diskretionär. Ziel des Prämienüberschusses ist es, einen mit der tatsächlichen Marktphase weitestgehend unkorrelierten Ertragsstrom zu generieren (Absolute-Return-Gedanke). Ziel des Überhangs an Long-Optionen ist es, bei starken Markteinbrüchen einen gewissen Schutz gegen Verluste im Fondswert anzustreben und darüber hinaus die Möglichkeit, bei Markteinbrüchen zusätzliche Erträge zu erwirtschaften. Des Weiteren wird aktives Risikomanagement betrieben, um das Risiko so gering wie möglich zu halten. Das Portfolio wird laufend überwacht und bewertet. Sobald die Risikokennziffern nicht mehr im Gleichgewicht sind, erfolgt ein regelbasierter Absicherungsmechanismus. Der Fonds setzt Derivate als wesentlichen Bestandteil der Anlagestrategie ein. Diese beziehen sich überwiegend auf marktbreite Standardindizes und dienen insbesondere der Renditegenerierung sowie der Steuerung des Portfolios. Für die eingesetzten Derivate erfolgt keine Berücksichtigung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale. Die Zuordnung der Vermögensgegenstände erfolgt positionsbezogen auf Basis ihrer jeweiligen Marktwerte. Eine Anrechnung von Derivaten auf Grundlage ökonomischer Exposures (z. B. Nominalwerte oder Delta-Äquivalente) erfolgt nicht. Die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale werden ausschließlich durch die direkt gehaltenen Vermögensgegenstände erfüllt.

Aufteilung der Investitionen

Es ist geplant, dass mindestens 80% der Vermögensgegenstände des Fonds (exklusive Bankguthaben und Derivate) die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erfüllen. Es gibt keinen Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen. Weiterhin tätigt der Fonds andere Investitionen in Höhe von bis zu 20% des Wertes des Fonds, die nicht auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet sind. Diese werden unter anderem zum Zweck der Diversifikation, zur Absicherung, zu Investitionszwecken oder, im Falle der Barmittel, zur Liquiditätssteuerung getätigt. Für diese Investitionen existiert kein Mindestschutz.

Der Fonds setzt Derivate als wesentlichen Bestandteil der Anlagestrategie ein. Diese beziehen sich überwiegend auf marktbreite Standardindizes und dienen insbesondere der Renditegenerierung sowie der Steuerung des Portfolios. Für die eingesetzten Derivate erfolgt keine Berücksichtigung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale und keine ESG-Durchschau auf Ebene der zugrunde liegenden Indexbestandteile.

Die Zuordnung der Vermögensgegenstände erfolgt positionsbezogen auf Basis ihrer jeweiligen Marktwerte. Eine Anrechnung von Derivaten auf Grundlage ökonomischer Exposures (z. B. Nominalwerte oder Delta-Äquivalente) erfolgt nicht. Die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale werden ausschließlich durch die direkt gehaltenen Vermögensgegenstände im Rahmen der in den Besonderen Anlagebedingungen definierten Anlagegrenzen erfüllt, die unter Anwendung der festgelegten Nachhaltigkeitskriterien ausgewählt werden.

Überwachung der ökologischen oder sozialen Merkmale

Die Gesellschaft stellt regelmäßig sicher, dass die im Fonds getätigten Investitionen den beworbenen Nachhaltigkeitskriterien, insbesondere den unter „Ökologische oder Soziale Merkmale des Finanzprodukts“ genannten, entsprechen. Dies geschieht vorwiegend anhand von Daten renommierter Anbieter von Nachhaltigkeitsdaten.

Angewandte Methoden

Zur Messung der Erreichung der beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wird auf die ESG-Datenbank renommierter Anbieter für Nachhaltigkeitsdaten zurückgegriffen (insb. MSCI ESG Research und/oder ISS Stoxx). Für diesen Fonds wird primär auf ISS Stoxx zurückgegriffen. Als Nachhaltigkeitsindikatoren werden dabei herangezogen (exklusive Bankguthaben und Derivate):

- **Ausschlusskriterium für den Sektor kontroverse Waffen**
Dieses dient als Indikator dafür, inwieweit ein Unternehmen an der Herstellung und Verbreitung von kontroversen Waffen beteiligt ist.
- **Ausschlusskriterium bei Verstößen gegen den UN Global Compact**
Dieses dient als Indikator zur Analyse von Kontroversen des Unternehmens in Bezug auf die Prinzipien des UN Global Compact.
- **Ausschlusskriterien für kontroverse Sektoren**
Diese umsatzbezogenen Kriterien dienen als Indikator dafür, inwieweit ein Unternehmen in den genannten kontroversen Geschäftsfeldern (Kohle, Tabak) involviert ist.
- **Freedom House Index Kriterium bei Staatsemitenten**
Dieses dient als Indikator dafür, inwieweit Staatsemitenten als freie Staaten zu bewerten sind.
- **ESG-Profil-Kriterium**
Der Fonds investiert innerhalb der in den Besonderen Anlagebedingungen definierten Anlagegrenzen in Emittenten, die von einem durch die Gesellschaft anerkannten Anbieter für Nachhaltigkeits-Research unter ökologischen, sozialen und unternehmensführungsbezogenen Kriterien positiv bewertet worden sind.

Datenquellen und -verarbeitung

Die Gesellschaft greift auf Daten etablierter Drittanbieter zurück, z.B. MSCI ESG und ISS Stoxx. Eine weitere Aufbereitung der Daten findet nicht statt. Eigene Schätzungen für fehlende Daten werden nicht vorgenommen.

Beschränkung hinsichtlich der Methoden und Daten

Die Gesellschaft verwendet Daten renommierter externer Datenanbieter und führt kein eigenes Nachhaltigkeitsresearch durch. Aus diesem Grund werden keine Schätzungen für fehlende Datenpunkte vorgenommen, sodass mangelnde Daten ein limitierender Faktor für die Methodologie sind.

Sorgfaltspflicht

Nachhaltigkeitskriterien und -daten sind Bestandteil der unternehmensinternen Prozesse der Gesellschaft. Die Gesellschaft überprüft Methoden zur nachhaltigkeitsbezogenen Bewertung von Vermögensgegenständen regelmäßig und behält sich vor, diese bei Bedarf anzupassen. Darüber hinaus eröffnet sie ihren Mitarbeitenden das Absolvieren von themenbezogenen Fortbildungen, um einen fortlaufenden Kompetenzausbau zum Thema nachhaltige Kapitalanlage zu unterstützen. Darüber hinaus hält sich die Gesellschaft durch die Teilnahme an diversen Ausschüssen und Arbeitskreisen des BVI Bundesverband Investment und Asset Management e.V. über aktuelle Entwicklungen informiert.

Mitwirkungspolitik

Die Gesellschaft ist in ihrem Namen und mit den von ihr verwalteten Sondervermögen dem thematisch orientierten Pooled-Engagement-Programm von ISS beigetreten. Damit schafft die Gesellschaft für sich und die Anleger ihrer Sondervermögen eine kosteneffiziente Möglichkeit, weltweit gemeinsam mit anderen Anlegern und den Unternehmen an der Verbesserung ihres Risikomanagements und ihrer ESG-Performance zu arbeiten. Der globale Investorenpool mit gleichgesinnten Investoren ermöglicht es hierbei, mehr Einfluss auszuüben, als würden die Gesellschaft oder einzelne Anleger dies allein durchführen.

Bestimmter Referenzwert

Der Fonds verfolgt ein aktives Anlagekonzept. Ein Vergleichsindex für ökologische und soziale Merkmale wurde nicht festgelegt.

Versionierung

- 04.05.2026: Initiale Erstellung zur Fondsauflage

Erläuterungen und Disclaimer

Die vollständigen Angaben zu den von der BANTLEON Invest Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH verwalteten Publikumsfonds sind dem jeweiligen Verkaufsprospekt, dem Basisinformationsblatt (PRIIP-KID) sowie dem Jahres- und Halbjahresbericht zu entnehmen. Diese Unterlagen stellen in ihrer jeweils aktuellen Fassung die allein verbindliche Grundlage für einen Kauf von Fondsanteilen dar. Sie können in deutscher Sprache kostenlos unter <http://www.bantleon.com> abgerufen oder in schriftlicher Form bei der BANTLEON Invest Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH, Aegidientorplatz 2a, 30159 Hannover (Kapitalverwaltungsgesellschaft) und der BANTLEON GmbH, Aegidientorplatz 2a, 30159 Hannover angefordert werden. Für die in Luxemburg verwaltete »BANTLEON SELECT SICAV« können die Unterlagen zusätzlich in englischer Sprache kostenlos unter <http://www.bantleon.com> abgerufen oder in schriftlicher Form bei der Erste Bank der österreichischen Sparkassen AG, Am Belvedere 1, 1100 Wien (Kontakt- und Informationsstelle in Österreich), der LLB Swiss Investment AG, Claridenstrasse 20, CH-8002 Zürich (Vertreter in der Schweiz) und bei der UBS Switzerland AG, Bahnhofstrasse 45, CH-8001 Zürich (Zahlstelle in der Schweiz) angefordert werden.

Eine Zusammenfassung der Anlegerrechte inklusive weiterer Informationen zu Instrumenten der Rechtsdurchsetzung erhalten Sie in deutscher und englischer Sprache auf <https://www.bantleon.com/rechtliche-hinweise> bzw. <https://www.bantleon.com/en/general-information>. Die BANTLEON Invest Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH kann den Vertrieb von Publikumsfonds jederzeit widerrufen.

Die Berechnung der Wertentwicklung erfolgt auf Basis der täglichen Anteilspreise und der Wiederanlage der Ausschüttung (BVI-Methode). Sämtliche Kosten innerhalb des Fonds, mit Ausnahme des Ausgabeaufschlages, sind berücksichtigt. Im Zusammenhang mit dem Erwerb der Fondsanteile können zusätzliche Kosten entstehen wie beispielsweise Gebühren, Provisionen und andere Entgelte, die in der Darstellung nicht berücksichtigt wurden und sich negativ auf die Wertentwicklung auswirken können. Wertentwicklungen der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.

Die ausgegebenen Fondsanteile der Publikumsfonds dürfen nur in solchen Rechtsordnungen zum Kauf angeboten oder verkauft werden, in denen ein solches Angebot oder ein solcher Verkauf zulässig ist. Insbesondere dürfen die Fondsanteile weder an Personen innerhalb der USA noch an oder für Rechnung von US-Staatsbürgern, von in den USA ansässigen Personen oder von anderen Personen, die nach den in den USA geltenden Vorschriften als »US-Person« gelten, zum Kauf angeboten oder an diese verkauft werden. Dieses Dokument und die in ihm enthaltenen Informationen dürfen nicht in den USA verbreitet werden. Die Verbreitung und Veröffentlichung dieses Dokuments sowie das Angebot oder ein Verkauf der Anteile können auch in anderen Rechtsordnungen Beschränkungen unterworfen sein.

Sämtliche Angaben wurden mit höchster Sorgfalt erstellt. Für die Richtigkeit und Vollständigkeit kann jedoch keine Gewähr übernommen werden. Eine Haftung für etwaige Schäden, die direkt oder indirekt mit den vorliegenden Informationen zusammenhängen, ist ausgeschlossen.

Wird in diesem Dokument allein die Bezeichnung »BANTLEON« ohne Zusatz verwendet, sind damit die BANTLEON AG mit Sitz in Zürich (Schweiz) und sämtliche mit ihr verbundenen Unternehmen, insbesondere Tochtergesellschaften, gemeint (auch »BANTLEON Gruppe«).

Stand: Januar 2026