

Information auf der Internetseite gemäß Artikel 10 SFDR zum Fonds GAMCO Merger Arbitrage von GAMCO International SICAV

(a) Zusammenfassung

Der Fonds GAMCO Merger Arbitrage von GAMCO International SICAV (der „**Fonds**“) hält die Anforderungen von Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 zu nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („**SFDR**“) ein. Der Fonds tätigt Anlagen in Unternehmen mit Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung und bewirbt außerdem die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale („**E/S-Merkmale**“):

1. Globale Verbesserung von ökologischen, sozialen und Unternehmensführungsmerkmalen („**ESG**“)

Der Fonds bewirbt eine globale Verbesserung von ESG-Merkmalen durch die sorgfältige Berücksichtigung relevanter ökologischer, sozialer und Unternehmensführungskriterien nach Feststellung durch den Anbieter von ESG-Bewertungen Ethos Impact Inc. („**Ethos**“). Die ESG-Bewertung berücksichtigt die folgenden ESG-Aspekte: Unternehmensführung, Zugang zu grundlegenden Dienstleistungen, Bestechung und Korruption, Geschäftsethik, Beziehungen zur lokalen Bevölkerung, Datenschutz und -sicherheit, Emissionen, Abwasser und Abfall in Bezug auf den eigenen Betrieb, CO₂-Bilanz von Produkten und Dienstleistungen, ökologische und soziale Auswirkungen von Produkten und Dienstleistungen, Menschenrechte, Menschenrechte in Bezug auf die Lieferkette, Humankapital, Landnutzung und Biodiversität in Bezug auf die Lieferkette, Arbeitsschutz, Produktüberwachung, Resilienz, Ressourcenverbrauch sowie Ressourcenverbrauch in Bezug auf die Lieferkette.

2. Nachhaltige Unternehmensführung

Der Fonds fördert eine Unternehmensführung in Bezug auf Nachhaltigkeit von Management, Produkten und/oder Prozessen, indem er sowohl Einschluss- als auch Ausschlusskriterien anwendet, um einzelne Unternehmen zu ermitteln, die verglichen mit anderen Unternehmen aus ihrer Branche einen fundierten Ansatz an Nachhaltigkeit unter Beweis stellen.

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, einen langfristigen Kapitalzuwachs für Ihre Anlage anzustreben. Der Fonds verfolgt einen hochspezialisierten Anlageansatz, der darauf abzielt, Renditen in erster Linie durch den erfolgreichen Abschluss geplanter Fusionen, Übernahmen, kreditfinanzierter Übernahmen (Leveraged Buyouts) und anderer Arten von Unternehmensumstrukturierungen zu erzielen.

Mithilfe dieses Prozesses ermittelt das Anlageteam Anlagegelegenheiten, mit denen seiner Meinung nach das Anlageziel erreicht werden kann. Um bestimmte Anlagegelegenheiten zu identifizieren, setzt der Fonds eine mehrstufige Anlagestrategie ein, die (i) zum Anlagezeitpunkt ein Overlay-Verfahren für das ESG-Screening und eine Ausschlusspolitik vorsieht, um die Unternehmen zu ermitteln, die die Leitlinien des Fonds in Bezug auf ökologische, soziale und Unternehmensführungsmerkmale erfüllen (die „**nach ESG-Kriterien zulässigen Unternehmen**“), und investiert (ii) in ein diversifiziertes Wertpapierportfolio aus einer Auswahl von nach ESG-Kriterien zulässigen Unternehmen, die Kapitalverschmelzungs- oder Übernahmegeschäfte etc. angekündigt haben.¹ Die Einhaltung des Overlay-Verfahrens für das ESG-Screening, der Ausschlussrichtlinie und der Kriterien für gute Unternehmensführung werden kontinuierlich überwacht. Die Sorgfaltsprüfung wird durch

¹ Eine Aufschlüsselung der Schritte des Anlageprozesses können Sie Abschnitt „(d) Anlagestrategie“ der Information auf der Internetseite gemäß Artikel 10 SFDR zum Fonds GAMCO Merger Arbitrage von GAMCO International SICAV entnehmen.

Compliance-Prüfungen vor dem Abschluss von Geschäften und eine Überwachung nach deren Abschluss durchgeführt. Gabelli Funds LLC (der „**Anlageverwalter**“) hat verschiedene Maßnahmen implementiert, um auf potenzielle Verstöße gegen die verbindlichen ESG-Kriterien des Fonds zu reagieren.

Mindestens 51 % des Fondsportfolios werden aus Anlagen bestehen, die dem Teilbereich des Fondsportfolios zuzuordnen sind, der an E/S-Merkmalen ausgerichtet ist. Eine Anlage gilt dann als an E/S-Merkmalen ausgerichtet, wenn sie die Kriterien des ESG-Screeningverfahrens und der Ausschlussrichtlinie erfüllt. Deshalb wird bei jeder derartigen Anlage davon ausgegangen, dass sie gemäß Artikel 8 SFDR E/S-Merkmale bewirbt. Entsprechend werden höchstens 49 % des Fondsportfolios aus Anlagen bestehen, die dem Teilbereich des Fondsportfolios zuzuordnen sind, der „sonstige“ Anlagen enthält (d. h. Anlagen, die das ESG-Screeningverfahren und/oder die Ausschlussrichtlinie nicht bestehen).

Der Fonds setzt eine in der Branche anerkannte externe Ratingagentur mit umfangreichen Fähigkeiten (Ethos) als primäre Datenquelle für die Beurteilung der Förderung von E/S-Merkmalen ein, Anleger sollten aber beachten, dass in einigen Fällen die Datensätze aufgrund unterschiedlicher Herausforderungen in Bezug auf Datenqualität und -reichweite und abhängig von dem Sektor und/oder der Region, in denen ein Unternehmen tätig ist, auf modellierten (statt gemeldeten) Daten beruhen können.

Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Anlagen berücksichtigen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten nicht. Der Fonds berücksichtigt keine wesentlichen negativen Auswirkungen („**WNA**“) auf Nachhaltigkeitsfaktoren im Sinne der SFDR. Der Fonds bewirbt zwar ökologische und soziale Merkmale, hat nachhaltige Investitionen aber nicht als Anlageziel.

Der Fonds verwendet keine Benchmark als Referenzwert, um die oben genannten Merkmale zu erreichen. Außerdem ist nicht vorgesehen, dass der Anlageverwalter im Rahmen seiner E/S-Strategie eine Einbindungsrichtlinie implementieren wird.