

Offentliggjøring på nettsted iht. artikkel 10 i offentliggjøringsforordningen for GAMCO International SICAV – GAMCO Merger Arbitrage

(a) Sammendrag

GAMCO International SICAV – GAMCO Merger Arbitrage («**fondet**») overholder kravene som er fastsatt i artikkel 8 forordning (EU) 2019/2088 om offentliggjøring av bærekraftsrelaterte opplysninger i sektoren for finansielle tjenester («**offentliggjøringsforordningen**»). I tillegg til å foreta investeringer i selskaper som har gode rutiner for selskapsstyring, fremmer fondet følgende miljømessige og sosiale («**M/S**») egenskaper:

1. Global forbedring av miljømessige, sosiale og styringsmessige («ESG») forhold

Fondet fremmer forbedring av ESG gjennom en grundig vurdering av aktuelle miljømessige, sosiale og styringsmessige kriterier som fastsettes av leverandøren av ESG-vurderinger, Ethos Impact Inc. («**Ethos**»). ESG-vurderingene tar følgende ESG-aspekter i betraktning: Selskapsstyring, tilgang til basistjenester, bestikkelser og korrupsjon, forretningsetikk, relasjon til lokalsamfunn, personvern og datasikkerhet, utslipp, avløp og avfall, karbon – egen drift, karbon – produkter og tjenester, produkters og tjenesters M/S-innvirkning, menneskerettigheter, menneskerettigheter – forsyningskjeden, menneskelige ressurser, arealbruk og biomangfold, arealbruk og biomangfold – forsyningskjeden, yrkeshelse og -sikkerhet, produktstyring, robusthet, ressursbruk og ressursbruk knyttet til forsyningskjede.

2. Bærekraftig ledelse av selskaper

Fondet fremmer bærekraftig ledelse av selskaper med tanke på bærekraft i ledelse, produkter og/eller prosesser, ved at man benytter kriterier for både inkludering og ekskludering for å finne enkeltsselskaper som fremviser en grundig fremgangsmåte sammenlignet med konkurrenter.

Fondets investeringsmål er å oppnå vekst på investeringen på lang sikt. Fondet benytter en høyt spesialisert investeringsprosess som er utformet for å gi avkastning i hovedsak fra gjennomføringen av vellykkede fusjoner, oppkjøp, oppkjøpstilbud, lånefinansierte oppkjøp og andre typer reorganisering av selskaper.

Gjennom denne prosessen vil investeringsteamet finne investeringsmuligheter som man anser kan oppnå investeringsmålet. For å identifisere slike investeringsmuligheter vil fondet anvende en investeringsstrategi med flere trinn som (i) bruker en ESG-filtreringsprosess og en ekskluderingspolitikk på investeringstidspunktet for å finne de selskapene som oppfyller fondets retningslinjer med hensyn til miljømessige, sosiale og styringsmessige egenskaper («**ESG-kvalifiserte selskaper**») og (ii) investerer i en diversifisert portefølje bestående av verdipapirer fra et utvalg ESG-kvalifiserte selskaper som har offentliggjort transaksjoner med fusjon eller oppkjøp o.l.¹ Overholdelsen av ESG-filtreringsprosessen, ekskluderingspolitikken og kriterier for god selskapsstyring overvåkes løpende. Aktsomhetsvurderinger utføres i form av samsvarskontroller før handel og overvåking etter handel. Gabelli Funds LLC («**investeringsforvalteren**») har på plass ulike tiltak som er rettet inn mot mulige brudd på fondets bindende ESG-kriterier.

Minst 51 % av fondets portefølje vil bestå av investeringer som passer inn i den delen av fondets portefølje som er innrettet etter M/S-egenskapene. En investering anses å være innrettet etter M/S-egenskapene hvis det oppfyller ESG-filtreringsprosessen og

¹ En oversikt over trinnene som inngår i investeringsprosessen finnes i avsnittet «(d) Investeringsstrategi» i offentliggjøringen på nettstedet iht. artikkel 10 i offentliggjøringsforordningen for GAMCO International SICAV – GAMCO Merger Arbitrage.

ekskluderingspolitikken, og derfor vil enhver slik investering anses å fremme M/S-egenskapene, som påkrevd av artikkel 8 i offentlighetsforordningen. Dermed skal ikke mer enn 49 % av fondets portefølje bestå av investeringer som faller inn i den «Annet»-delen av fondets portefølje (som ikke oppfyller ESG-filtreringsprosessen og ekskluderingspolitikken).

Selv om fondet benytter et eksternt vurderingsbyrå med en kapasitet som anerkjennes i bransjen (Ethos) som hovedkilde for data for å vurdere fremmelsen av M/S-egenskapene, bør investorer være oppmerksomme på at i noen tilfeller kan datasettene baseres i modellererte (ikke-rapporterte) data grunnet ulike utfordringer med hensyn til datakvalitet og -dekning, avhengig av hvilken sektor og/eller region de ulike selskapene opererer i.

Investeringene som er underliggende i dette finansproduktet, tar ikke EUs kriterier for miljømessig bærekraftig virksomhet i betraktning. Fondet vurderer ikke de fremste skadevirkninger (såkalte **PAI**) for bærekraftsfaktorer i den betydning dette har i offentlighetsforordningen. Selv om fondet fremmer M/S-egenskaper, har det ikke målsetting om bærekraftige investeringer.

Fondet bruker ikke noe referanseindeks med formål om å oppnå egenskapene som er nevnt ovenfor. Videre er det ikke planlagt at investeringsforvalteren skal benytte en engasjementspolitikk som del av M/S-strategien.