

Artikel 10 SFDR webbplatsinformation för GAMCO International SICAV – GAMCO Merger Arbitrage

(a) Sammanfattning

GAMCO International SICAV – GAMCO Merger Arbitrage ("**fonden**") uppfyller kraven i artikel 8 i förordning (EU) 2019/2088 om hållbarhetsrelaterade upplysningar inom sektorn för finansiella tjänster ("**SFDR**"). Förutom att investera i företag som har god bolagsstyrningspraxis främjar fonden följande miljömässiga och sociala ("**E/S**") egenskaper:

*1. Förbättring av globala miljömässiga, sociala och styrningsmässiga ("**ESG**") egenskaper*

Fonden främjar global förbättring av ESG genom att noggrant beakta relevanta miljömässiga, sociala och styrningsmässiga kriterier som fastställts av ESG-värderingsleverantören Ethos Impact Inc. ("**Ethos**"). ESG-värderingen tar hänsyn till följande ESG-aspekter: Bolagsstyrning, tillgång till grundläggande tjänster, mutor och korruption, affärsetik, samhällsrelationer, datasekretess och datasäkerhet, utsläpp, avloppsvatten och avfall, koldioxid - egen verksamhet, koldioxid – produkter och tjänster, E&S-påverkan av produkter och tjänster, mänskliga rättigheter, mänskliga rättigheter – leveranskedjan, humankapital, markanvändning och biologisk mångfald, markanvändning och biologisk mångfald – leveranskedjan, arbetsmiljö, produktstyrning, resiliens, resursanvändning samt resursanvändning i relation till leveranskedjan.

2. Hållbar företagsledning

Fonden främjar företagsledning med avseende på hållbar förvaltning, produkter och/eller processer genom att tillämpa kriterier för både inkludering och exkludering för att identifiera enskilda företag som uppvisar en genomtänkt hållbarhetsstrategi jämfört med branschkollegor.

Fondens placeringsmål är att se till att din investering växer på lång sikt. Fonden använder en mycket specialiserad investeringsstrategi som är utformad för att huvudsakligen ge avkastning genom ett framgångsrikt genomförande av föreslagna fusioner, övertaganden, uppköpserbudanden, lånefinansierade utköp och andra typer av omorganisationer av företag.

Genom denna process kommer investeringsgruppen att identifiera investeringsmöjligheter som den anser kan bidra till att uppnå investeringsmålet. För att identifiera vissa investeringsmöjligheter använder fonden en investeringsstrategi i flera steg som (i) tillämpar en ESG-överlagringsprocess och en uteslutningspolicy vid investeringstillfället för att identifiera de företag som uppfyller fondens riktlinjer med avseende på miljömässiga, sociala och styrningsmässiga egenskaper ("**ESG-berättigade företag**"), och (ii) investerar i en diversifierad portfölj av värdepapper från ett urval av ESG-berättigade företag som har tillkännagivit fusioner och förvärv av aktier med mera.¹ Efterlevnaden av ESG-granskningsprocessen, uteslutningspolicy och kriterierna för god bolagsstyrning övervakas fortlöpande. Due diligence utförs genom efterlevnadskontroller före handel och övervakning efter handel. Gabelli Funds LLC ("**investeringsförvaltaren**") har implementerat olika åtgärder för att hantera potentiella överträdelser av fondens bindande ESG-kriterier.

Minst 51 % av fondens portfölj kommer att bestå av investeringar som passar in i den del av fondens portfölj som är anpassad till E/S-egenskaper. En investering kommer att anses vara i linje med E/S-egenskaper om den uppfyller ESG-granskningsprocessen och uteslutningspolicy, och därför kommer alla sådana investeringar att anses främja E/S-

¹ För en uppdelning av de steg som ingår i investeringsprocessen, se avsnittet "(d) Investeringsstrategi" i artikel 10 SFDR webbplatsinformation för GAMCO International SICAV – GAMCO Merger Arbitrage.

egenskaper, enligt kraven i artikel 8 i SFDR. Följaktligen kommer inte mer än 49 % av fondens portfölj att bestå av investeringar som passar in i den del av fondens portfölj som är "Övrigt" (dvs. investeringar som inte uppfyller ESG-granskningsprocessen och/eller uteslutningspolicyn).

Även om fonden använder ett branscherkänt kreditvärderingsinstitut med omfattande kapacitet (Ethos) som primär datakälla för att bedöma främjandet av E/S-egenskaper, bör investerare notera att datamängder i vissa fall kan baseras på modellerade (snarare än rapporterade) data på grund av olika utmaningar med avseende på datakvalitet och täckning, beroende på vilken sektor och/eller region ett företag verkar i.

De investeringar som ligger till grund för denna finansiella produkt tar inte hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet. Fonden beaktar inte huvudsakliga negativa effekter ("PAI") på hållbarhetsfaktorer i den mening som avses i SFDR. Även om fonden främjar E/S-egenskaper har den inte hållbara investeringar som mål.

Fonden använder ingen jämförelsenorm för att uppnå ovanstående karaktär. Dessutom finns det ingen avsikt att investeringsförvaltaren ska använda en engagemangspolicy som en del av sin E/S-strategi.