TKB NACHHALTIGKEITS-REPORT

03.07.2024

TKB Strategiefonds Ausgewogen ESG (CHF)

Durch MSCI bewertbare Abeckung: 90%

MSCI ESG RATING

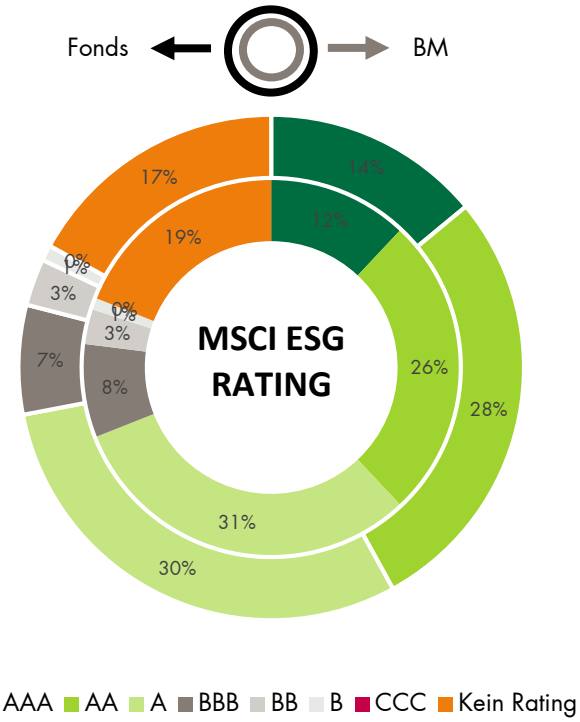
Fonds	BM
AA	A

MSCI QUALITY SCORE

Fonds	BM
7.2	7.0

MSCI ESG Rating Skala

8.6 - 10	AAA
7.1 - 8.6	AA
5.7 - 7.1	A
4.3 - 5.7	BBB
2.9 - 4.3	BB
1.4 - 2.9	B
0 - 1.4	CCC



Environmental Score

Fonds	BM
6.2	6.0

Social Score

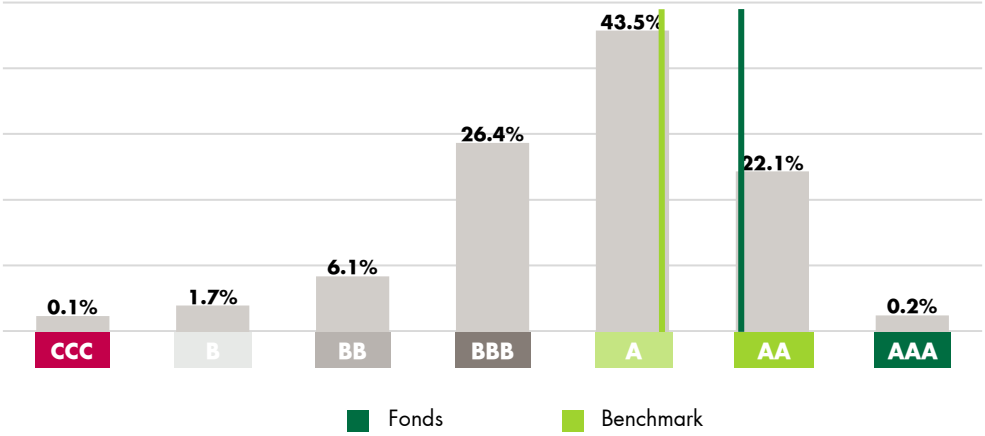
Fonds	BM
5.3	5.1

Governance Score

Fonds	BM
6.3	6.2

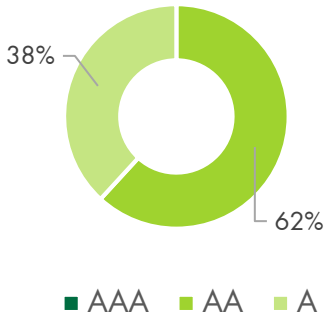
ITR
2.1°C

MSCI ESG Fund Rating Universum

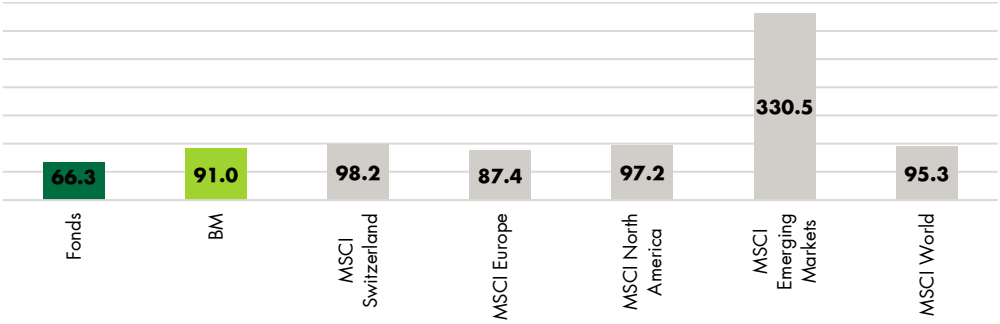


MSCI Peer-Universum: Mixed - Balanced CHF

Anzahl Fonds = 110



Carbon Risk (t CO2e/$M Umsatz)



Quelle: MSCI ESG

Fondsgesellschaften der eingesetzten Zielfonds entsprechen den **UN PRI**

Signatory of:

PRI Principles for Responsible Investment

Disclaimer: Diese Publikation dient ausschliesslich Werbezwecken. Sie stellt weder ein Angebot noch eine Empfehlung zum Kauf oder Verkauf von Finanzinstrumenten dar und ersetzt nicht die persönliche anlegergerechte Beratung vor einem Anlage- oder Investitionsentscheid. Alle Informationen können jederzeit und ohne vorgängige Ankündigung ändern. Sie erfolgen ohne Gewähr und ohne Übernahme einer Haftung. Basisinformationen und Prospekte zu den Finanzanlageprodukten sind bei den Beraterinnen und Beratern der TKB erhältlich. Datenquelle: MSCI.

Thurgauer Kantonalbank

GLOSSAR TKB NACHHALTIGKEITS-REPORT

Durch MSCI bewertbare Abdeckung
Die durch MSCI bewertbare Abdeckung zeigt, wie viel Prozent des Gesamtportfolios einen MSCI Score haben. 100% würde anzeigen, alle Investments im Portfolio haben eine MSCI ESG Bewertung. Der taktische Liquiditätsanteil im TKB Strategiefonds wird ebenfalls berücksichtigt, und zwar mit dem MSCI Score der Depotbank.

MSCI ESG Rating
Das MSCI ESG Rating bewertet die langfristigen ESG Chancen und Risiken eines Fonds und wird auf einer Skala von AAA (höchstes Rating) bis CCC (niedrigstes Rating) angegeben. Die Höhe des Ratings hängt davon ab, wie stark die Unternehmen innerhalb des Fonds branchenspezifischen Nachhaltigkeitsrisiken ausgesetzt und inwieweit sie im Vergleich zu den Mitbewerbern in der Lage sind, diese Risiken zu minimieren. Das Gesamtportfolio-Rating wird relativ auf Branchenbasis gemessen, die Einzel-Ratings E, S und G dagegen auf absoluter Basis. Daher ist das Gesamt-Rating nicht als Durchschnitt der Einzel-Ratings E, S und G zu betrachten.

MSCI Quality Score
Der MSCI Quality Score bewertet die Widerstandsfähigkeit eines Fonds gegenüber langfristigen ESG Risiken auf einer Skala von 0 (niedrigster Wert) bis 10 (höchster Wert).

Environmental, Social und Governance Score
Die Säulen-Scores Environmental, Social und Governance (Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) werden auf absoluter Basis berechnet und berücksichtigen die Chancen und Risiken in der jeweiligen Säule. Sie bilden eine Grundlage zur Berechnung des MSCI ESG Ratings und des MSCI ESG Quality Scores.

MSCI Peer-Universum
Das MSCI Peer-Universum zeigt, die prozentuale Verteilung der Anlagefonds in der Vergleichsgruppe (Peer-Gruppe), z.Bsp. Mixed Assets - Balanced CHF. Die Skala geht von CCC bis AAA. Weitere Details zur Abstufung siehe "MSCI ESG Fund Rating Universum".

MSCI ESG Fund Rating Universum
Die Grafik zeigt das Universum und die Ratingverteilung der im MSCI ESG Portal enthaltenen Fonds (rund 28´000) und repräsentiert den Prozentsatz des Marktvolumens der Fonds, die in den Kategorien ESG Rating Leaders (AAA und AA), Average (A, BBB und BB) und Laggards (B und CCC) eingestuft sind. Die senkrechten Striche (dunkelgrün, hellgrün) repräsentiert die aktuelle Bewertung des Fonds und der Benchmark.

Carbon Risk
Diese Kennzahl wird ausgedrückt als gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität und misst das Engagement eines Fonds in kohlenstoffintensiven Unternehmen im Vergleich zur Benchmark. Sie entspricht der Summe aus den Wertpapiergewichten multipliziert mit der jeweiligen Kohlenstoffintensität (emittierte Tonnen CO2e / USD Mio. Umsatz). Je niedriger der Carbon Risk Wert ist, desto geringer ist die Kohlenstoffintensität, was erstrebenswert ist.

Implied Temperatur Rise (ITR)
Der implizite Temperaturanstieg von MSCI ESG Research ist eine intuitive, zukunftsorientierte Kennzahl, die in Grad Celsius ausgedrückt wird. Zur Ermittlung werden die Verpflichtungen zu Netto-Null-Emissionen („net-zero emissions") der investierten Unternehmen herangezogen. Dadurch lässt sich die Ausrichtung der Unternehmen bzw. ganzer Portfolios und Fonds an den globalen Temperaturzielen (Pariser Klimaabkommen) aufzeigen.

Fondsgesellschaften der eingesetzten Zielfonds entsprechen den UN PRI
Alle Asset Manager der eingesetzten Zielfonds müssen die "Principles for Responsible Investment" (UN PRI) unterzeichnet haben. Die Prinzipien für verantwortliches Anlegen sind eine im 2006 gegründete Investoreninitiative in Partnerschaft mit der Finanzinitiative des UN-Umweltprogramms (UNEP) und dem UN Global Compact. Das Ziel der insgesamt 6 Prinzipien ist es, die Auswirkungen von Nachhaltigkeit bei Investitionen zu vermitteln und die Unterzeichner dabei zu unterstützen, diese Themen in ihren Investitionsentscheidungsprozess einzubauen. So tragen die Unterzeichner zu einem nachhaltigeren globalen Finanzsystem bei.