

Información en materia de sostenibilidad

FINECO INVESTMENT OFFICE/ ROBECO

A.	Resumen	2
B.	Sin objetivo de inversión sostenible	2
C.	Características medioambientales o sociales del producto financiero.....	2
D.	Estrategia de inversión.....	2
E.	Proporción de inversiones.....	3
F.	Seguimiento de las características medioambientales o sociales	3
G.	Métodos.....	3
H.	Fuentes y tratamiento de datos.....	4
I.	Limitaciones de los métodos y datos.....	4
J.	Diligencia debida.....	4
K.	Políticas de implicación	5
L.	Índice de referencia designado	5

A. Resumen

El fondo promueve características medioambientales y sociales.

El fondo promueve, fundamentalmente, las siguientes características medioambientales: la reducción de las emisiones contaminantes (CO₂, gases derivados de los combustibles fósiles y otros gases contaminantes), un uso responsable de los recursos naturales y tratamiento de residuos.

Las características sociales que promueve el fondo son, la defensa de los derechos humanos, la defensa de la salud y la reducción de la producción de armas controvertidas.

Adicionalmente, el fondo cuenta con un ideario sostenible, que impulsa las inversiones con una exposición positiva a indicadores medioambientales y sociales. Esto se alcanza a través una metodología propia patentada que permite aplicar a emisores públicos y privados criterios valorativos ESG que miden de forma agregada la contribución de dichos emisores al logro de los Objetivos de Desarrollo Sostenible de las Naciones Unidas.

B. Sin objetivo de inversión sostenible

Este producto financiero promueve características medioambientales o sociales, pero no tiene como objetivo una inversión sostenible.

C. Características medioambientales o sociales del producto financiero

Las características ambientales que promueve el fondo son, fundamentalmente, la reducción de las emisiones de gases de efecto invernadero (CO₂, gases derivados de los combustibles fósiles y otros gases contaminantes).

Las características sociales que promueve el fondo son, la defensa de los derechos humanos, la defensa de la salud y la reducción de la producción de armas controvertidas.

D. Estrategia de inversión

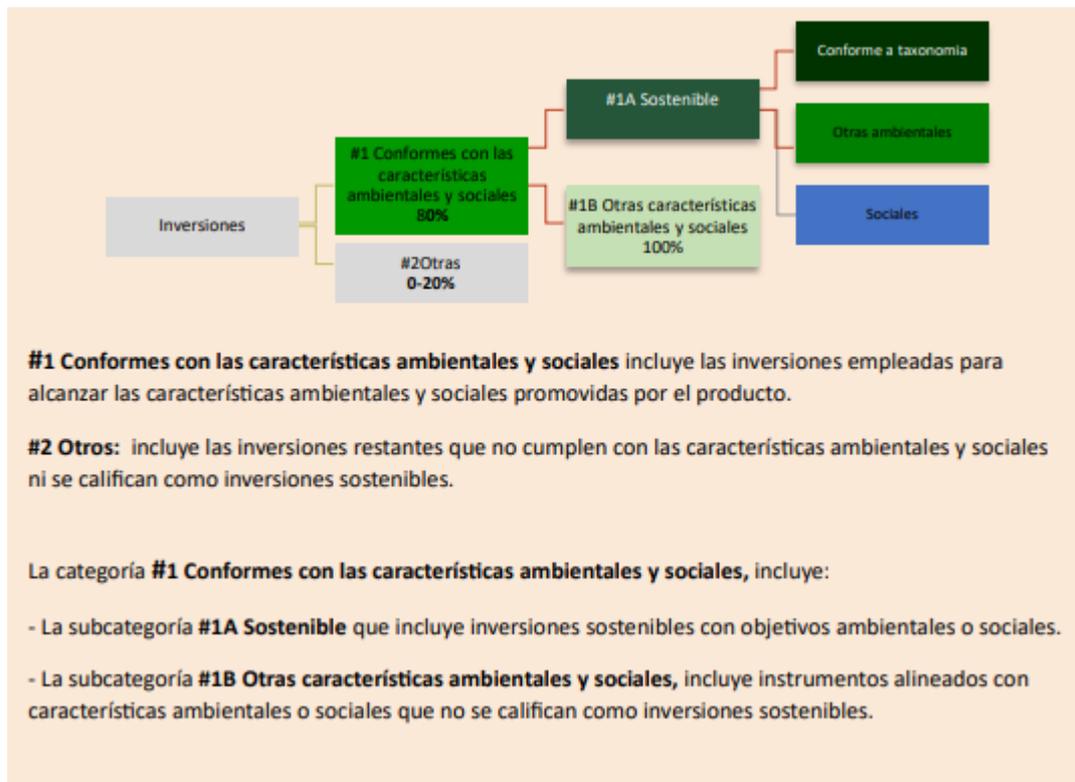
La gestión activa del compartimento invierte en una variedad de tipos de activos como renta variable, bonos e instrumentos del mercado monetario. El objetivo de la estrategia es obtener una rentabilidad superior al índice de referencia. La gestión toma como referencia la rentabilidad del 65% Bloomberg Global-Aggregate Index y 35% MSCI AllCountry World Index. La estrategia invierte en varios fondos de renta fija y variable de Robeco y RobecoSAM y otros productos de terceros. El equipo de gestión puede utilizar otros instrumentos de inversión para aumentar el perfil de rentabilidad-riesgo de la estrategia, siempre dentro de los límites marcados por el mandato de gestión.

La Política de Buena Gobernanza de Robeco aplica para las inversiones realizadas en fondos de Robeco (tienen una política que permite medir las prácticas de buen gobierno de sus inversiones). Para la inversión en compañías, esta política incorpora, entre otros requisitos, relacionados con las estructuras de gestión,

relaciones laborales, remuneración del personal y cumplimiento fiscal. Para las inversiones en emisores soberanos y supranacionales, esta política describe prácticas de buen gobierno similares. Para más información: <https://www.robeco.com/docm/docu-robecogood-governance-policy.pdf>.

E. Proporción de inversiones

El objetivo es que al menos el 80% de las inversiones cumplen con las características ambientales y sociales de la estrategia. La inversión en otras clases de activos, que se estima entre un 0 -20%, es mayormente en ETFs para ganar exposición a materias primas, fondos no considerados artículos 8 o 9 y otros activos. La asignación de activos se monitoriza de forma continuada y se evalúa con una periodicidad anual.



F. Seguimiento de las características medioambientales o sociales

El equipo gestor monitoriza las características medioambientales a través del análisis de los datos obtenidos de los distintos indicadores utilizados para medir el progreso de la cartera del fondo. Específicamente se ha depurado durante el periodo la metodología de cálculo y estudio de los indicadores de sostenibilidad de mano del cambio del proveedor interno de datos a Bloomberg.

G. Métodos

El fondo utiliza los siguientes indicadores de sostenibilidad para medir las características ambientales o sociales:

1. El porcentaje de las inversiones en fondos de artículos 8 y 9 bajo SFDR.

Para la inversión directa en Bonos Soberanos la estrategia utiliza los siguientes indicadores:

1. El porcentaje de inversión en valores que están incluidos en la lista de exclusiones al aplicar la Política de Exclusión.
2. La media obtenida en el "Country Sustainability Ranking" Sustainable investing - Country Sustainability Ranking (robeco.com).

H. Fuentes y tratamiento de datos

El equipo gestor se ha dotado de la herramienta de Bloomberg PORT Enterprise para llevar a cabo el estudio de los indicadores y la medición y monitorización de las Principales Incidencias Adversas. PORT incluye el contenido ESG para simplificar la evaluación de las Principales Incidencias Adversas de la cartera del fondo. Las métricas ESG reportadas de las compañías se basan en sus últimas cuentas anuales.

La calidad de los datos se garantiza en la medida que la herramienta resulta fiable ante la disponibilidad de información en cada momento.

Los datos son tratados por el equipo gestor a través de su metodología propia en el análisis y control de la información disponible a través de las métricas proporcionadas por la herramienta PORT Enterprise.

La información puede ser incompleta en ocasiones dada la falta de reporte por entidades a las que se les realiza el desglose en el estudio de las inversiones del fondo, en estos casos el equipo gestor es consciente de que puede estar contando con ciertos datos obtenidos por estimación.

I. Limitaciones de los métodos y datos

La gestora considera que las diferentes fuentes de datos utilizadas ofrecen información suficiente, completa y fiable para evaluar y tomar las decisiones de inversión en línea con las características que promueve el fondo.

A pesar de la mejora en la metodología el equipo es consciente a la hora de valorar el cumplimiento de las características medioambientales o sociales, de la falta de disponibilidad de datos y del impacto que tiene esto sobre la exactitud del resultado, por lo que se ha tratado la información desde este prisma en todo momento.

J. Diligencia debida

La gestora lleva a cabo en el marco de la toma de decisiones y control posterior de inversión, el proceso de diligencia debida a través de la recopilación y análisis de la información necesaria sobre los activos, sus emisores y gestores terceros.

En este sentido, la selección de activos deberá cumplir con los criterios de selección establecidos con el objetivo de cumplir con la promoción de las características medioambientales y sociales descritas anteriormente.

K. Políticas de implicación

El Fondo no tiene como parte de su estrategia medioambiental o social la implicación de los accionistas.

No obstante, GIIC FINECO SGIC, S.A.U. dispone de una Política de Implicación a largo plazo de los accionistas que detalla los procedimientos para el ejercicio de los derechos inherentes a los valores integrados en los fondos gestionados en beneficio exclusivo de los partícipes. Esta política está disponible en la página web de la gestora.

L. Índice de referencia designado

No se ha designado un índice específico como índice de referencia para determinar si el producto está en consonancia con las características medioambientales o sociales que promueve.