

# Información en materia de sostenibilidad

## FINECO INVESTMENT OFFICE/ SCHRODERS

---

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.....	4
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 compartimento mantiene un resultado de sostenibilidad mayor que el Índice de referencia (50% MSCI AC World EUR and 50% Bloomberg Barclays Global Aggregate Bond Index (hedged to EUR)), basado en el sistema de evaluación de la entidad gestora, SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT (EUROPE), S.A.. Los índices que componen el Índice de referencia no tienen en cuenta las características medioambientales y sociales que promueve el compartimento.

El resultado de sostenibilidad se mide a través del método propio de Schroders, que proporciona una aproximación sobre el "impacto neto" que un emisor crea en términos de "costes" y "beneficios" medioambientales y sociales. Este resultado se obtiene utilizando ciertos indicadores relacionados con el emisor (como pueden ser emisiones de gases de efecto invernadero, consumo de agua o salarios acordes al salario mínimo) y cuantificándolos positiva y negativamente para producir una medida teórica agregada que refleje el efecto que tiene ese emisor subyacente en la sociedad y en el medioambiente. Esto se realiza empleando información de terceros, así como estimados y asunciones teóricas de Schroders, esto genera que el resultado pueda diferir de otras herramientas y medidas de sostenibilidad.

El resultado se expresará de forma agregada en relación a los indicadores de sostenibilidad para cada emisor, especialmente en un porcentaje (positivo o negativo) de las ventas del emisor subyacente que se esté evaluando.

## B. Sin objetivo de inversión sostenible

Este producto financiero promueve características medioambientales o sociales y tiene un objetivo medioambiental y social en actividades económicas que no se consideren medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE.

## C. Características medioambientales o sociales del producto financiero

En relación con el porcentaje del compartimento que tiene objetivos de inversiones sostenibles, cada inversión sostenible denota un efecto positivo en al menos uno de los objetivos medioambientales o sociales, como resulta de la evaluación del método previamente mencionado.

Estos objetivos de las inversiones sostenibles que el fondo pretende realizar de forma parcial pueden incluir, aunque sin limitarse al incremento de "beneficios" sociales o medioambientales como mayor acceso al agua o salarios dignos, o a la reducción de "costes" medioambientales o sociales como la emisión de gases de efecto invernadero o desperdicio de alimentos.

## D. Estrategia de inversión

Respecto a la selección de valores donde invertir y el posterior seguimiento de estas inversiones, tanto de manera directa como a través de IIC, además de los criterios financieros se aplican criterios extra-financieros o ASG, basados en el ideario sostenible.

demás de los criterios financieros, de los criterios extra financieros ESG que se aplican mediante exclusiones (derechos humanos, protección medioambiental, reducción de la producción de armamento controvertido)

y valoración (emisores que tengan en cuenta aspectos medioambientales, sociales y de gobernanza). Más del 50% de las inversiones en renta variable cumplen (directa o indirectamente) con el ideario sostenible.

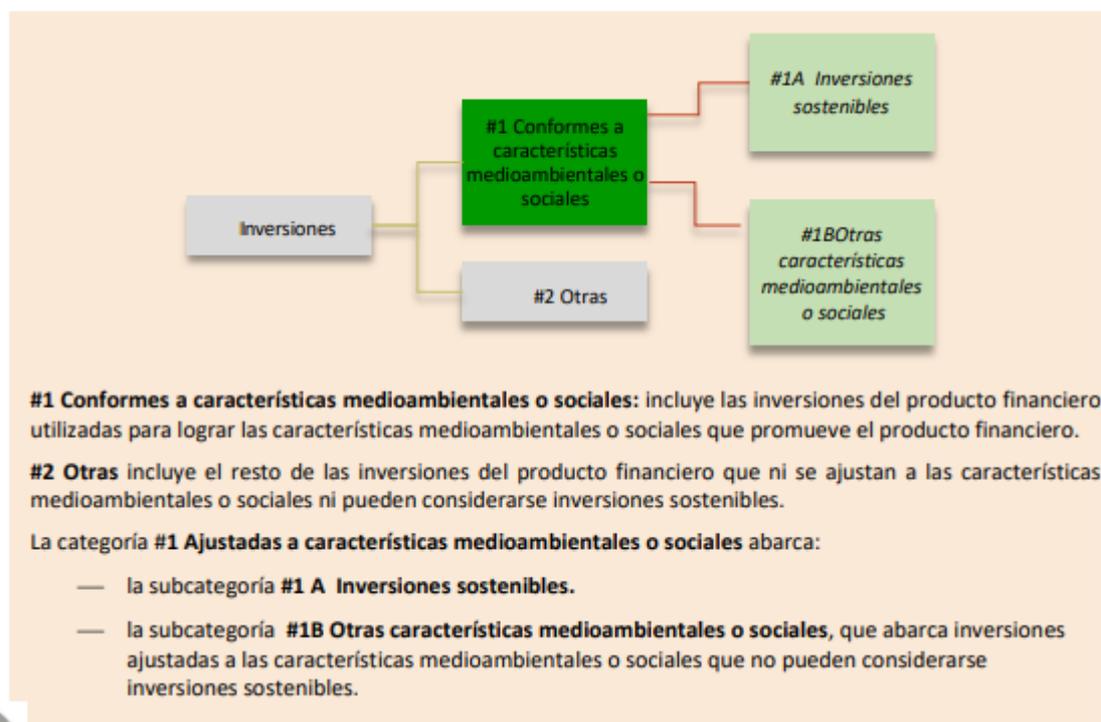
## E. Proporción de inversiones

La composición de las inversiones del compartimento tiene como objetivo cumplir las características sociales o medioambientales definidas a continuación:

#1 Conforme con las características medioambientales y sociales: supone el porcentaje mínimo de los activos del compartimento que se utilizan para cumplir características medioambientales y sociales, el cual supone un 60%. El compartimento se compromete a mantener un resultado superior al índice de referencia (50% MSCI AC World EUR and 50% Bloomberg Barclays Global Aggregate Bond Index (hedged to EUR)), por lo que los activos calificados como tal por el método propio de Schrodgers se incluyen en este #1. Dentro de esta categoría, aquellos activos que tengan una inversión sostenible se denominan #1<sup>a</sup>. La proporción mínima será aplicable siempre en situaciones normales de mercado.

El compartimento invierte al menos un 10% de sus activos en inversiones sostenibles. Dentro de ese 10% no hay un porcentaje mínimo para activos con objetivos medioambientales o sociales.

#2 Otras, incluye el resto de las inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse inversiones sostenibles.



## 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 compartimento monitoriza el cumplimiento con las características a mantener el resultado de sostenibilidad general superior al conjunto de los índices de referencia mencionados según la evaluación realizada a través del método propio de Schroders y comparándolo con el resultado promedio de los índices de referencia que refleja la asignación de activos del compartimento. Ambos resultados se basan en información recibida a fin de mes sobre el semestre anterior. El resultado general agrega el efecto de los indicadores de sostenibilidad incluyendo, pero sin limitarse a, emisiones de gases de efecto invernadero, consumo de agua o salarios acordes al salario mínimo.

## 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.