

onemarkets

UC European Movers Balanced Fund

Prezentare site web – Document de sinteză

1. NU EXISTĂ NICIUN OBIECTIV INVESTIȚIONAL SUSTENABIL

Acest produs financiar promovează caracteristici de mediu și sociale, dar nu are ca obiectiv investiții sustenabile.

2. CARACTERISTICILE DE MEDIU ȘI/SAU SOCIALE PROMOVATE DE FOND

Subfondul promovează caracteristicile de mediu prin sprijinirea tranziției către o economie cu emisii reduse de carbon, contribuind la atenuarea schimbărilor climatice și la expunerea la proiecte de finanțare cu efecte pozitive asupra mediului, inclusiv prin expunerea la obligațiuni ecologice.

Acesta promovează caracteristicile sociale prin încurajarea respectării normelor internaționale, a drepturilor omului și a standardelor de muncă, evitând expunerea la activități dăunătoare sănătății umane și sprijinind buna guvernare și cooperarea internațională.

Aceste caracteristici sunt protejate în portofoliul de finanțare prin strategia de excludere ESG a societății de administrare (www.structuredinvest.lu) și sunt urmărite în mod mai cuprinzător în portofoliul strategic prin cadrul de excludere, indicele orientat spre tranziție UC Capture-the-Change (de reflectare a schimbării și de capturare a creșterii) și expunerea la obligațiuni ecologice.

3. STRATEGIA DE INVESTIȚII

Subfondul își pune în aplicare strategia de investiții în două etape. În primul rând, investește în acțiuni cotate la bursă și, în mod auxiliar, în certificate, fonduri de investiții, obligațiuni, instrumente ale pieței monetare, numerar și/sau depozite, care împreună formează portofoliul de finanțare. Performanța acestui portofoliu este transferată prin intermediul unui swap pe profitul total raportat la o rată fluctuantă, astfel încât acesta să îndeplinească în principal un rol tehnic de facilitare a strategiei. Portofoliul de finanțare rămâne supus strategiei de excludere ESG a societății de administrare, asigurându-se că și deținerile temporare respectă garanțiile minime de mediu și sociale.

În al doilea rând, Subfondul încheie un swap suplimentar pe profitul total pentru a obține expunere pe portofoliul strategic, care este principalul motor al caracteristicilor de mediu și sociale promovate. Această strategie constă în 40-60% acțiuni care reproduc indicele UC Capture-the-Change, combinate cu obligațiuni din categoria investițiilor și denumite în euro, incluzând obligațiuni ecologice aliniate la standarde recunoscute. Metodologia indicelui pe acțiuni își ajustează treptat selecția pentru a recompensa companiile care reduc emisiile de gaze cu efect de seră și își sporesc alinierea la taxonomia UE, sprijinind astfel tranziția către o economie cu emisii reduse de carbon.

Cel puțin 80% din portofoliul strategic este aliniat la caracteristicile de mediu sau sociale promovate de Subfond în conformitate cu elementele obligatorii ale strategiei de investiții.

4. PROPORȚIA INVESTIȚIILOR

Investițiile Sub-fondului sunt aliniate, în proporție de cel puțin 80%, cu caracteristicile E/S (nr. 1 Aliniate cu caracteristicile E/S) și sunt investite, proporție de până la 20%, în Alte (nr. 2 Alte) active. Subfondul nu intenționează să realizeze investiții durabile. 0% din active sunt investite în conformitate cu un obiectiv de mediu din cadrul taxonomiei UE.

5. MONITORIZAREA CARACTERISTICILOR DE MEDIU SAU SOCIALE

Managerul de investiții monitorizează continuu Subfondul utilizând datele și evaluările ESG ISS pentru a identifica modificările factorilor de sustenabilitate ai emitenților.

La nivelul managerului de investiții au fost definite procese de control intern pentru a asigura monitorizarea criteriilor de excludere și a ponderii minime de investiții de mediu și sociale.

6. METODOLOGII

Consultantul în investiții agregă datele ESG ISS la nivel de portofoliu, în special pentru indicatorii principalelor efecte negative (PEN) legați de criteriile de excludere și de cele pozitive. Aceste date ajută la evaluarea conformității cu criteriile de excludere și cu cele minime și urmăresc evoluția caracteristicilor vizate. În cazul în care criteriile de mediu sau sociale suferă schimbări negative, consultantul în investiții evaluează motivele schimbărilor respective.

7. SURSE DE DATE ȘI PRELUCRAREA ACESTORA

Consultantul în investiții se bazează pe datele ESG ISS pentru evaluarea factorilor de mediu și sociali. Aceasta include cifra de afaceri, practicile controversate, gestionarea schimbărilor climatice, emisiile și scorurile aferente. Sursele de date includ diverse entități și estimări ale ESG ISS. Consultantul în investiții verifică aleatoriu plauzibilitatea datelor, folosind doar datele disponibile pentru evaluarea criteriilor de excludere. Evaluarea criteriilor pozitive poate omite emitenți cu puncte de date lipsă, care pot fi totuși incluși dacă respectă criteriile de excludere.

8. LIMITĂRI ALE METODOLOGIILOR ȘI DATELOR

Consultantul în investiții nu poate verifica în totalitate datele ESG ISS, în special în ceea ce privește taxonomia UE și indicatorii PEN, ceea ce afectează calitatea datelor. Există incertitudini cu privire la măsura în care emitenții se vor alinia pe viitor la obiectivele de sustenabilitate. Datele limitate și verificate privind sustenabilitatea conduc la utilizarea unor surse neverificate și la estimări, care pot necesita revizuire. Diversitatea criteriilor și punctelor de date reduce riscul asociat datelor. Datele sunt actualizate continuu și păstrate pentru urmărirea abaterilor.

9. DILIGENȚA NECESARĂ

Consultantul în investiții a stabilit procese pentru colectarea și integrarea datelor ESG ISS în sistemele sale informatice pentru monitorizarea continuă a Subfondului. Acest lucru asigură respectarea criteriilor ecologice și sociale, cu ajustări prompte ale portofoliului în cazul unor eventuale abateri.

10. POLITICI DE ANGAJAMENT

Consultantul în investiții nu participă la reprezentarea intereselor investitorilor în cadrul adunărilor generale și nu exercită drepturi de vot, din diverse motive.

Criteriile de mediu și sociale sunt evaluate continuu, iar companiile neconforme sunt vândute sau înlocuite prompt dacă nu sunt îndeplinite criteriile pozitive.

11. ETALON DE REFERINȚĂ DESEMNAȚ

Sub-fondul nu prevede un etalon de referință care să fi fost desemnat în scopul obținerii caracteristicilor de mediu sau sociale promovate de Sub-fond.