

Zverejňovanie informácií o produkte na webových stránkach podľa čl. 10(1) Nariadenia o zverejňovaní informácií o udržateľnosti v sektore finančných služieb pre čl. 8 podfondov

SÚHRN

Názov produktu:

CPR Invest – B&W European Strategic Autonomy 2029

Identifikátor právneho subjektu:

213800U5GM6NT7NAN130

Bez udržateľného investičného cieľa

Tento finančný produkt presadzuje environmentálne a sociálne vlastnosti, nemá však trvalo udržateľný investičný cieľ

Environmentálne alebo sociálne vlastnosti finančného produktu

Podfond presadzuje environmentálne a/alebo sociálne vlastnosti s cieľom dosiahnuť vyššie skóre ESG ako skóre ESG indexu 50% ICE BofA 3-5 Year Euro Corporate Index + 50% ICE BofA BB-B Euro High Yield Constrained Index („referenčný index“).

Pri stanovení skóre ESG podfondu a (ďalej len „Referenčného indexu“) sa výkonnosť ESG hodnotí porovnaním priemernej výkonnosti cenného papiera voči odvetviu emitenta cenného papiera, pokiaľ ide o každú z troch vlastností ESG týkajúcich sa životného prostredia, sociálnej oblasti a riadenia.

Podiel investícií

Najmenej 75 % cenných papierov a nástrojov podfondu sa použije na splnenie presadzovaných environmentálnych alebo sociálnych vlastností v súlade so záväznými prvkami investičnej stratégie podfondu.

Okrem toho sa podfond zaväzuje dosiahnuť minimálne 10 % udržateľných investícií podľa nižšie uvedenej tabuľky. Investície zosúladené s ostatnými vlastnosťami E/S budú predstavovať rozdiel medzi skutočným podielom investícií v súlade s environmentálnymi alebo sociálnymi vlastnosťami a skutočným podielom udržateľných investícií. Plánovaný podiel ostatných investícií do životného prostredia predstavuje minimálne 10 % a môže sa meniť so zvyšujúcim sa skutočným podielom taxonomicky zosúladených a/alebo sociálnych investícií.

Monitorovanie, metodiky, zdroje údajov a ich obmedzenia, postupy náležitej starostlivosti a postupy angažovanosti

Všetky údaje o ESG, či už externe alebo interne spracované, sú centralizované líniou pre Zodpovedné investičné podnikanie, ktorá je zodpovedná za kontrolu kvality vstupov a spracovaných výstupov ESG. Toto monitorovanie zahŕňa automatizovanú kontrolu kvality, ako aj kvalitatívnu kontrolu od analytikov ESG, ktorí sú špecialistami vo svojom sektore. Hodnotenia ESG sa aktualizujú mesačne v rámci modulu vlastného nástroja spoločnosti Amundi Stock Rating Integrator (SRI).

Ukazovatele udržateľnosti používané v rámci spoločnosti Amundi sa spoliehajú na patentované metodiky. Tieto ukazovatele sú nepretržite k dispozícii v systéme správy portfólia, ktorý umožňuje manažerom portfólia vyhodnocovať vplyv ich investičných rozhodnutí.

Tieto ukazovatele sú navyše zakomponované do kontrolného rámca Amundi, pričom zodpovednosti sa rozdeľujú medzi prvú úroveň kontrol, ktoré vykonávajú samotné investičné tímy, a druhú úroveň kontrol vykonávaných tímami pre riziká, ktoré monitorujú súlad s environmentálnymi alebo sociálnymi vlastnosťami presadzovanými fondom na priebežnej báze.

Hodnotenie ESG Amundi použité na stanovenie skóre ESG je kvantitatívne hodnotenie ESG rozložené do siedmich stupňov, v rozsahu od A (najlepšie skóre) po G (najhoršie). Na stupnici hodnotenia ESG spoločnosti Amundi zodpovedajú cenné papiere zo zoznamu vylúčených skóre G. Pre podnikových emitentov sa výkonnosť ESG posudzuje globálne a na úrovni relevantných kritérií v porovnaní s priemernou výkonnosťou svojho odvetvia prostredníctvom kombinácie troch rozmerov ESG.

Metodika použitá hodnotením ESG spoločnosti Amundi využíva 38 kritérií, ktoré sú buď generické (spoločné pre všetky spoločnosti bez ohľadu na ich činnosť) alebo špecifické pre odvetvie, ktoré sú zvažované podľa odvetvia a posudzované vzhľadom na svoj vplyv na reputáciu, prevádzkovú účinnosť a nariadenia týkajúce sa emitenta. Hodnotenia ESG spoločnosti Amundi budú pravdepodobne vyjadrené globálne v troch rozmeroch E, S a G alebo individuálne na akomkoľvek environmentálnom alebo sociálnom faktore.

Skóre ESG spoločnosti Amundi sa zostavujú pomocou rámca analýzy ESG spoločnosti Amundi a metodiky hodnotenia. Získavame údaje z nasledujúcich zdrojov skóre ESG: Moody, ISS-Oekom, MSCI a Sustainalytics.

Obmedzenia našej metodiky sú konštrukčne spojené s používaním údajov ESG. Oblasť údajov ESG sa v súčasnosti štandardizuje, čo môže mať vplyv na kvalitu údajov; taktiež pokrytie údajov je obmedzením. Súčasná a budúca regulácia zlepší štandardizované vykazovanie a poskytovanie podnikových informácií, na ktoré sa údaje ESG spoliehajú.

Uvedomujeme si tieto obmedzenia, ktoré zmierňujeme kombináciou prístupov.

Každý mesiac sa hodnotenie ESG prepočítava na základe kvantitatívnej metodiky Amundi. Výsledok tohto výpočtu potom posudzujú analytici ESG, ktorí vykonávajú kvalitatívnu „kontrolu vzorkovania“ v jeho sektore na základe rôznych kontrol.

Spoločnosť Amundi zapája spoločnosti, do ktorých sa investuje alebo potenciálne môže investovať, na úrovni emitenta bez ohľadu na typ držby (vlastné imanie a dlhopisy).