

Divulgación de información relativa a la sostenibilidad

MAINFIRST - ABSOLUTE RETURN MULTI ASSET

Morningstar Sustainability Rating™



RESUMEN

Para cumplir las características medioambientales y sociales, el producto utiliza una combinación de criterios de exclusión y un sistema de puntuación. MainFirst Absolute Return Multi Asset debe presentar en promedio un perfil del riesgo ESG intermedio o mejor. Para ello, nos basamos en los análisis de la agencia de calificación externa Sustainalytics. Los factores no financieros, como la consideración de criterios ambientales, sociales y de gobernanza (ESG), en particular en lo que respecta a los riesgos de reputación, se tienen activamente en cuenta en los procesos de inversión y de decisión.

SIN OBJETIVO DE INVERSIÓN SOSTENIBLE

Este producto financiero tiene en cuenta características ambientales y sociales, pero no tiene como objetivo principal la inversión sostenible en el sentido del Reglamento de Taxonomía de la UE (2020/852).

CARACTERÍSTICAS AMBIENTALES O SOCIALES DEL PRODUCTO FINANCIERO

MainFirst Absolute Return Multi Asset debe presentar en promedio un perfil del riesgo ESG intermedio o mejor. Para ello, nos basamos en la puntuación del riesgo ESG de la agencia de calificación externa Sustainalytics.

Además, la pretensión de sostenibilidad de MainFirst Absolute Return Multi Asset se ve confirmada por la exclusión de los siguientes sectores:

 <p>FILTRO AMBIENTAL EXCLUSIÓN: Petróleo y gas, arenas bituminosas / gas de esquisto, carbón, energía nuclear, producción de plástico de un solo uso, no ratificación de la biodiversidad de la ONU, no ratificación del Acuerdo de París</p>	 <p>FILTRO DE SALUD EXCLUSIÓN: Semillas modificadas genéticamente, tabaco, productores de azúcar</p>	 <p>FILTRO SALUD EXCLUSIÓN: Entretenimiento para adultos, no ratificación de la no proliferación nuclear, países no libres o corruptos</p>	 <p>EXCLUSIÓN BASADA EN NORMAS: Vulneración de los principios del Pacto Mundial de la ONU</p>
---	--	---	---

Asimismo, se tienen en cuenta las principales incidencias adversas:

- | | |
|--|--|
| <ol style="list-style-type: none"> 1. «Emisiones de gases de efecto invernadero» (ámbito 1, ámbito 2, ámbito 3) 2. «Huella de carbono» 3. «Intensidad de gases de efecto invernadero» 4. «Participación en empresas activas en el sector de los combustibles fósiles» 10. «Vulneraciones de los principios del Pacto Mundial de las | <p>Naciones Unidas y las Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales»</p> <ol style="list-style-type: none"> 14. «Exposición al sector de las armas controvertidas» (minas antipersonas, municiones en racimo, armas químicas y armas biológicas) <p>Además, las empresas se someten a una revisión de controversias basada en datos de Sustainalytics. Esta evalúa la implicación de las empresas en incidentes con repercusiones negativas sobre aspectos ambientales, sociales y de gobernanza (ESG).</p> |
|--|--|

ESTRATEGIA DE INVERSIÓN

MainFirst Absolute Return Multi Asset es un fondo mixto de inversión mundial cuyo objetivo es generar una rentabilidad positiva a largo plazo superior al 5% con un nivel de riesgo aceptable. A estos efectos, el fondo recurre a una estructura de inversión ampliamente diversificada de renta variable, renta fija, divisas y materias primas a escala mundial. Hasta el 50% del patrimonio del fondo puede invertirse en renta variable. La selección de valores se efectúa a largo plazo conforme a un enfoque temático que se centra en temas de futuro de crecimiento estructural, tales como Internet móvil, industria 4.0 y marcas globales. Para la selección y la asignación de las inversiones, se utilizan indicadores técnicos así como análisis fundamental ascendente (bottom up) y descendente (top down). Se presta especial atención en todo momento al atractivo del perfil de riesgo-remuneración. Al mismo tiempo, el riesgo absoluto de pérdida se supervisa y controla continuamente mediante análisis de riesgos cuantitativos y cualitativos. A estos efectos, también puede cubrirse tácticamente la parte de renta variable y divisas mediante futuros.

PROPORCIÓN DE INVERSIONES

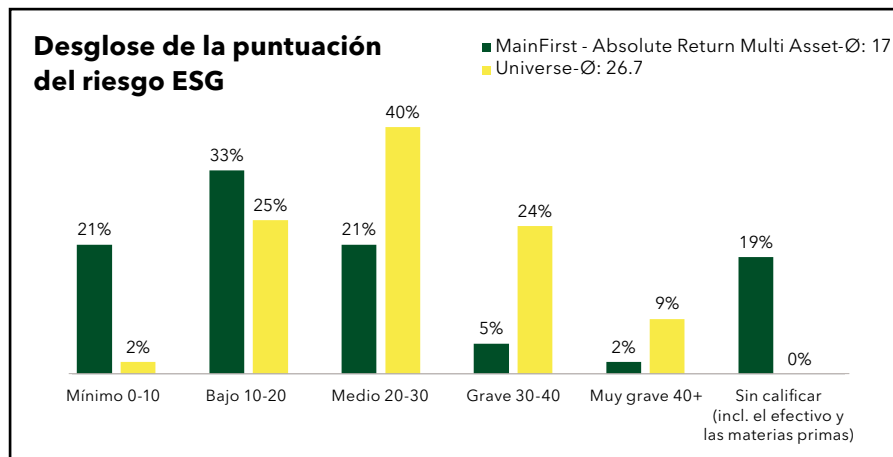
El producto no tiene como objetivo invertir únicamente en valores sostenibles en el sentido del Reglamento sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (SFDR). Los factores ESG se tienen en cuenta en cada decisión de inversión.

MÉTODOS

Las calificaciones de sostenibilidad del proveedor de calificaciones Sustainalytics facilitan el proceso de toma de decisiones, mediante una clasificación exhaustiva de las inversiones de acuerdo con factores relacionados con la sostenibilidad, como ambientales, sociales y de gobierno corporativo. La clasificación de las puntuaciones del riesgo ESG se realiza de forma global y en todo el universo analizado. La puntuación media ponderada del riesgo ESG de las empresas incluidas en la cartera se compara con la puntuación media ponderada del universo de inversión. MainFirst Absolute Return Multi Asset debe presentar en promedio un perfil del riesgo ESG intermedio o mejor. Para todos los valores que no están cubiertos por Sustainalytics, llevamos a cabo nuestro propio análisis ESG interno.

SUPERVISIÓN DE LAS CARACTERÍSTICAS AMBIENTALES O SOCIALES

El desglose de la calificación del riesgo ESG se supervisa diariamente y se publica periódicamente.



Source: Sustainalytics, 30 December 2022

FUENTES Y TRATAMIENTO DE DATOS

La principal fuente de datos para el análisis ESG es Sustainalytics. Los datos necesarios se almacenan en el sistema de gestión de órdenes para el cumplimiento anterior y posterior a la operación.

LIMITACIONES DE LOS MÉTODOS Y LOS DATOS

Las empresas más pequeñas todavía informan poco sobre los riesgos ESG y las consiguientes medidas adoptadas, por lo que se dispone de menos datos para estas y existe el riesgo de que las empresas más pequeñas obtengan una puntuación más baja en la calificación ESG de Sustainalytics o no tengan ninguna calificación ESG. En muchos casos, disponen de pocos datos para preparar sus propios análisis ESG.

DILIGENCIA DEBIDA

La revisión interna de los criterios y procesos corre a cargo del departamento de gestión de carteras, cumplimiento normativo de las inversiones y gestión del riesgo. La revisión externa de los indicadores y las puntuaciones facilitados corre a cargo de Sustainalytics. Por otra parte, nuestros procesos han sido revisados por FNG.

POLÍTICAS DE IMPLICACIÓN

El proceso de participación activa se basa en los tres pilares siguientes:

1. diálogo directo,
2. proceso de participación activa formal,
3. compromiso social.

véase la

- [Política ESG](#)
- [Política de voto](#)
- [Folleto de venta](#)

Aviso legal

El presente documento recoge los datos en materia ESG sobre este fondo que el inversor debe conocer. No se trata de material de promoción comercial. La ley exige que se facilite esta información para ayudarle a comprender la naturaleza del fondo y los riesgos que comporta invertir en él en el contexto ESG. Es aconsejable que lea el documento para poder tomar una decisión fundada sobre la conveniencia o no de invertir en él. Podrá obtener gratuitamente, durante el horario normal de trabajo, información adicional sobre el subfondo, el folleto de venta vigente junto con el anexo y los estatutos, así como los últimos informes anuales y semestrales en alemán, inglés y francés a través de la sociedad de inversión, sociedad gestora, el depositario, el distribuidor o distribuidores y el agente de pagos.

Un subfondo de MainFirst (sociedad de inversión de capital variable). La gestión del fondo corre a cargo de MainFirst Affiliated Fund Managers S.A. (sociedad anónima). Si desea más información sobre el fondo, visite nuestro sitio web (www.mainfirst.com).

Datos a 01/01/2023