

Resumen de la información sobre sostenibilidad - Enero de 2023

Sin objetivo de inversión sostenible

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

Características medioambientales o sociales del producto financiero

Este producto promueve características medioambientales y/o sociales. Para ello, trata de invertir en empresas con buenas prácticas medioambientales y/o sociales y buena gobernanza. Para medir la promoción de las características medioambientales y/o sociales, el producto financiero se basa en el sistema de calificación ESG de Palatine AM. Considera los 6 pilares siguientes: Política de recursos humanos, medidas de protección del medio ambiente, respeto de los derechos humanos, ética empresarial, prácticas de gobernanza y relaciones con las comunidades locales.

Estrategia de inversión

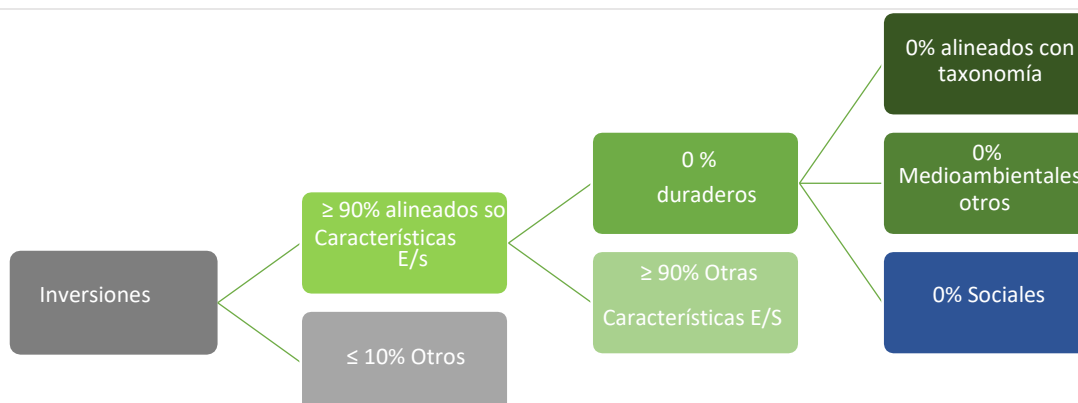
El fondo invierte principalmente en empresas de gran capitalización y alta liquidez, que forman parte del S & P500 ESG, apoyándose en una solución de inversión cuantitativa, basada en la inteligencia artificial, que utiliza un modelo para predecir el movimiento y la evolución del precio de las acciones.

El modelo analiza miles de características históricas y da una predicción diaria del comportamiento de cada acción analizada como si se dispusiera de un especialista en cada valor. A continuación, alimenta su proceso activo de selección para producir una cartera de posiciones largas en algunos valores. Para poder ser admisibles en la cartera, las empresas deben demostrar, a través de un filtro ISR, que gestionan lo mejor posible sus oportunidades y riesgos ESG.

Los elementos vinculantes del enfoque extrafinanciero para seleccionar las inversiones son los siguientes:

1. Exclusiones (carbón, armas controvertidas, violación del Pacto Mundial o de los principios de la OCDE)
2. ESG: Selección de empresas con las mejores calificaciones ESG para mostrar una calificación ESG media de la cartera superior a la de su índice de referencia

Proporción de inversión



Control de las características medioambientales o sociales
<p>Los controles se realizan a 3 niveles:</p> <p>1/Los controles del 1º nivel pre-trade realizados por los gestores (o el algoritmo) que deben asegurarse de que el emisor seleccionado corresponde al universo de la cartera y está calificado en el plano ESG. Estos controles pre-trade no están sujetos a una formalización específica.</p> <p>2/Los controles del 1º nivel post-trade realizados trimestrialmente por el equipo de análisis ISR sobre las normas de selectividad (verificación de la cobertura suficiente de las calificaciones ESG y del cumplimiento de los demás criterios relacionados con la ISR).</p> <p>3/Los controles del 2º nivel realizados anualmente por la RCCI a través de una ficha de control ESG-ISR.</p>
Métodos
<p>El indicador de medida de la promoción de las características E/S se basa en la calificación ESG. Palatine AM considera que el fondo ha conseguido promover con éxito las características medioambientales y/o sociales cuando presenta una calificación ESG media superior a la de su índice de referencia.</p>
Fuentes y procesamiento de datos
<p>La sociedad gestora se basa en las bases de datos extrafinancieras de Moody's ESG Solutions para las grandes capitalizaciones, EthiFinance para las medianas y pequeñas capitalizaciones y de Trucost (S & P Global), para los datos medioambientales (sobre el carbono, los riesgos climáticos, etc.). La empresa Humpact proporciona indicadores relacionados con el empleo.</p> <p>Palatine AM dispone también de acceso a la búsqueda de brokers especializados (como Goldman Sachs, Sociéte Générale, Exane, Oddo, etc.).</p> <p>Se realizan evaluaciones ESG internas para completar y mejorar los datos facilitados por las agencias de calificación a partir de datos publicados por las empresas.</p>
Límites a los métodos y datos
<p>Palatine AM es consciente de la existencia de límites metodológicos que pueden proceder, en particular, de la calidad y disponibilidad de los datos ESG, proporcionados por sociedades de calificación extrafinanciera o directamente de empresas, utilizados en sus estrategias ESG.</p> <p>No obstante, Palatine AM pondrá en marcha los dispositivos necesarios para reducir al máximo estos límites. El análisis extrafinanciero se basa en varios proveedores de datos ESG. Las evaluaciones de los proveedores de datos están validadas por los conocimientos especializados de los analistas internos y se enriquecen con una vigilancia interna de las controversias que es difícil prever. La rendición de cuentas del PMA forma parte de un enfoque transparente y continuo de mejoramiento.</p>
Diligencia debida
<p>Este producto financiero realiza su proceso de diligencia debida a través de su estrategia de inversión ISR. Todos los activos, salvo efectivo y cuasil efectivo, son objeto de una valoración ESG. Incluye varios indicadores sobre derechos humanos. La selección de valores se realiza entre los emisores que registran los mejores resultados.</p>
Política de compromiso
<p>El compromiso de las empresas mantenidas en el fondo Palatine Amérique se realiza a través del ejercicio de nuestro derecho de voto y otros derechos vinculados a la renta variable.</p>
Índice de referencia designado
<p>La IIC Palatine Amérique ha definido un índice de referencia para medir su promoción de las características medioambientales y/o sociales. Es el S & P500 ESG, está en línea con la estrategia de inversión de la IIC, y se centra en las grandes capitalizaciones estadounidenses con buenas prácticas ESG.</p>