

Divulgaciones de productos del sitio web en virtud del art. 10(1) del Reglamento sobre Transparencia en materia de Finanzas Sostenibles para el art. 8 fondos:

RESUMEN

Name: SABADELL BONOS FLOTANTES, FI

Legal entity identifier: 9598008GS6VKR172CD81

Ningún objetivo de inversión sostenible

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

Características medioambientales o sociales del producto financiero

El Fondo promueve características ESG (Medioambientales, Sociales y Gobierno Corporativo) invirtiendo en acciones de compañías teniendo en cuenta no solo aspectos económicos y financieros sino también la dimensión ESG en sus decisiones de inversión.

- A) Dimensión medioambiental. Se analiza la capacidad de las compañías para controlar su impacto medioambiental directo e indirecto, limitando su consumo de energía, reduciendo las emisiones de gases con efecto invernadero, luchando contra el agotamiento de los recursos y protegiendo la biodiversidad.
- B) Dimensión social. El objetivo aquí es medir cómo una compañía define una estrategia para desarrollar su capital humano, basándose en principios fundamentales con un alcance universal. La "S" en el ámbito ESG tiene un doble significado: el aspecto social ligado al capital humano de la compañía y el aspecto relacionado con los derechos humanos, cohesión social, capital humano y derechos civiles.
- C) Dimensión de gobierno corporativo. Esta dimensión evalúa la capacidad del emisor para asegurar el establecimiento de un marco de gobierno corporativo eficaz que garantice el logro de los objetivos a largo plazo (garantizando en consecuencia el valor de la compañía a largo plazo). En cuanto a emisores soberanos el objetivo es evaluar el desempeño en cuanto a la eficacia del gobierno y coyuntura económica.

El Fondo promueve las características medioambientales y/o sociales con el objetivo de tener una puntuación ESG más alta que la puntuación ESG del índice Bloomberg Euro Floating Rate Notes Index (el "valor de referencia"). Al determinar la puntuación ESG del Fondo y el índice de referencia, la valoración ESG se evalúa comparando la valoración promedio de un valor con su sector, en cada una de las tres características ambientales, sociales y de gobernanza de ESG. El Benchmark es un índice de mercado amplio que no evalúa ni incluye componentes de acuerdo con características ambientales y/o sociales y, por lo tanto, no pretende ser consistente con las características que promueve el Fondo. No se ha designado ningún índice de referencia ESG.

Proporción de inversiones

Al menos el 75 % de las inversiones del Fondo se utilizarán para lograr las características medioambientales o sociales promovidas por el Fondo de acuerdo con los elementos vinculantes de la estrategia de inversión. El Fondo se compromete a mantener un mínimo del 10% en inversiones sostenibles y la proporción restante de las inversiones se invertirá en activos con características medioambientales y sociales.

Supervisión, métodos, fuentes de datos y sus limitaciones, diligencia debida y políticas de implicación

Todos los datos ESG, ya sean procesados externa o internamente, están centralizados por la línea de negocio de Inversiones Responsable, que es la responsable de controlar la calidad de la información recibida y de los resultados ESG procesados. Esta supervisión incluye un control de calidad automatizado, así como un control cualitativo realizado por analistas ESG especializados en sus sectores. Las puntuaciones ESG se actualizan mensualmente en el módulo Stock Rating Integrator (SRI) de la herramienta patentada de Amundi.

Los indicadores de sostenibilidad utilizados en Amundi se basan en metodologías propias. Estos indicadores están continuamente disponibles en el sistema de gestión de carteras, lo que permite a los gestores de carteras evaluar el impacto de sus decisiones de inversión.

Además, estos indicadores están integrados en el marco de control de Amundi, con una distribución de responsabilidades entre el primer nivel de controles llevados a cabo por los propios equipos de inversión y el segundo nivel de controles llevados a cabo por los equipos de riesgo, que supervisan el cumplimiento de las características medioambientales o sociales promovidas por el fondo de forma continua.

La calificación ESG de Amundi utilizada para determinar la puntuación ESG es una puntuación cuantitativa ESG traducida a siete niveles, que van de A (el universo de las mejores puntuaciones) a G (las peores puntuaciones). En la escala de calificación ESG de Amundi, los valores que pertenecen a la lista de exclusión se corresponden con una G. Para los emisores corporativos, la rentabilidad ESG se evalúa a nivel global y a nivel de criterios relevantes comparándola con la rentabilidad media de su sector mediante la combinación de las tres dimensiones ESG.

La metodología aplicada por la calificación ESG de Amundi utiliza 38 criterios, que pueden ser genéricos (comunes a todas las empresas, independientemente de su actividad) o específicos para cada sector, ponderados en función del sector y considerados en términos de su impacto en la reputación, la eficiencia operativa y las normativas en relación con un emisor. Es probable que las calificaciones ESG de Amundi se expresen globalmente en las tres dimensiones E, S y G, o de forma individual en cualquier factor medioambiental o social.

Las puntuaciones ESG de Amundi se generan utilizando el marco de análisis ESG y la metodología de puntuación de Amundi. Obtenemos datos de las siguientes fuentes de puntuaciones ESG: Moody, ISSOekem, MSCI y Sustainalytics.

Las limitaciones de nuestra metodología están vinculadas por construcción al uso de datos ESG. El panorama de datos ESG se está estandarizando actualmente, lo que puede afectar a la calidad de los datos; la cobertura de datos también supone una limitación. La normativa actual y futura mejorará los informes estandarizados y las divulgaciones corporativas en las que se basan los datos ESG.

Somos conscientes de estas limitaciones que mitigamos mediante una combinación de enfoques.

Cada mes, la puntuación ESG se vuelve a calcular de acuerdo con la metodología cuantitativa de Amundi. A continuación, los analistas ESG revisan el resultado de este cálculo y llevan a cabo un «control mediante muestreo» cualitativo de su sector basado en varias comprobaciones.

Amundi se implica en las empresas en las que invierte o en empresas en las que puede invertir en el nivel de emisor, independientemente del tipo de participaciones en cartera (renta variable y bonos).