



Samenvattend document

Robeco QI Global SDG and Climate Conservative Equities

Duurzaamheidsdoelstelling

Het Fonds bevordert de Duurzame Ontwikkelingsdoelen (SDG's) van de VN en draagt bij aan het beperken van de maximale wereldwijde temperatuurstijging tot ruim onder 2 °C door de CO2-voetafdruk van de wereldwijde aandelenportefeuille te verkleinen.

Beleggingsstrategie

Robeco QI Global SDG & Climate Conservative Equities is een actief beheerd Fonds dat belegt in laagvolatiele aandelen van bedrijven uit ontwikkelde en opkomende landen over de hele wereld die een bijdrage leveren aan het realiseren van de Duurzame Ontwikkelingsdoelen (SDG's) van de VN en het beperken van de wereldwijde temperatuurstijging tot onder 2 °C. De selectie van deze aandelen is gebaseerd op een kwantitatief model. Conservative verwijst naar de focus op aandelen met een lagere verwachte volatiliteit dan het mondiale gemiddelde. De strategie integreert duurzaamheidsindicatoren voortdurend in het aandelenselectieproces. Het Fonds hanteert onder meer uitsluitingen op basis van normen en activiteiten en Robeco's beleid voor goed ondernemingsbestuur en het houdt rekening met belangrijke negatieve impact in het beleggingsproces.

Benchmark

Het fonds gebruikt de MSCI All Country World EU PAB Overlay Index als referentie-index om de doelstelling van het fonds voor het verkleinen van de CO2-voetafdruk te realiseren en daarmee de wereldwijde temperatuurstijging te beperken tot ruim onder de 2 °C.

Percentage van beleggingen

Het fonds wil minimaal 90% duurzaam beleggen en de rest van de beleggingen grotendeels in liquide middelen.

Monitoring en due diligence

Robeco heeft de duurzaamheidsaspecten van de beleggingsstrategieën opgenomen in adequate due diligenceprocessen en -procedures voor de selectie en monitoring van beleggingen, waarbij onder meer rekening wordt gehouden met Robeco's beleid inzake risicobereidheid en duurzaamheidsrisicobeheer. Portefeuillemanagers en analisten zijn primair verantwoordelijk voor het dagelijks uitvoeren van due diligenceonderzoek met betrekking tot hun strategieën. Zij worden ondersteund door onafhankelijke monitoring, uitgevoerd door de afdelingen Financieel risicobeheer en Beleggingsrestricties.

Databronnen, methodologieën en beperkingen

Het fonds gebruikt verschillende bronnen voor het verzamelen van duurzaamheidsgegevens. Robeco onderwerpt elke aanbieder aan een due diligenceonderzoek om de datakwaliteit te beoordelen, waarbij wordt gekeken naar het datamodel, statistische controles worden uitgevoerd en de dekking wordt geëvalueerd. Gegevensverwerking vindt plaats in verschillende vormen, waarbij de voorkeur altijd uitgaat naar een zo geautomatiseerd mogelijke gegevensverzameling om operationele risico's of onnodige menselijke interventie te voorkomen. Robeco houdt op onze website uitgebreide methodologische documenten bij van onze eigen analytische kaders. Daarnaast vertrouwt Robeco voor sommige sociale en milieukeurmerken op input van buitenaf, waarbij we ernaar streven om voor elk van onze doelkenmerken de beste leverancier te selecteren. De voornaamste beperking van de methodologie of de gegevensbron is het gebrek aan rapportage door bedrijven. Net zoals veel andere partijen op de financiële markten hebben ook wij moeite om adequate informatie te vinden over de indicatoren voor belangrijke negatieve impact. Om dit probleem op te lossen heeft Robeco zich gewend tot meerdere dataleveranciers, aangezien die allemaal hun eigen sterke en zwakke punten hebben.

Engagementstrategie

De belangen van het fonds zijn onderworpen aan het selectieproces van Robeco's Value Engagement-programma, dat bestaat uit een constructieve dialoog tussen beleggers en de bedrijven waarin ze beleggen. Ze bespreken daarbij hoe de bedrijven omgaan met ESG-risico's en -kansen en met impact op belanghebbenden. Hoewel dit type engagement niet direct verband houdt met de duurzame beleggingsdoelstelling van het fonds, kan het zijn dat nadelige duurzaamheidseffecten worden aangepakt via het Value Engagement-programma.