Informacje ujawniane okresowo dla produktów finansowych, o których mowa w art. 9 ust. 1 i 2 rozporządzenia (UE) 2019/2088 i w art. 5 rozporządzenia (UE) 2020/852Nazwa produktu: Santander Prestiż Prosperity

Identyfikator podmiotu prawnego: 259400UJ3OJLZ5KDK151
Poniższe informacje nie wchodzą w zakres badania przez biegłego rewidenta.

Aspekty środowiskowe i/lub społeczne

Czy niniejszy produkt finansowy służył celowi dotyczącemu zrównoważonych inwestycji ?

☒ **TAK**

☐ W ramach produktu dokonano **zrównoważonych inwestycji o celu środowiskowym:** ___%

☐ w działalność gospodarczą, która zgodnie z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju kwalifikuje się jako zrównoważona środowiskowo

☐ w działalność gospodarczą, która zgodnie z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju nie kwalifikuje się jako zrównoważona środowiskowo

☒ W ramach produktu dokonano **zrównoważonych inwestycji o celu społecznym:** 80,19%

☐ **NIE**

☐ Produkt **promował aspekty środowiskowe/ społeczne** i chociaż jego celem nie była zrównoważona inwestycja, miał … udziału w zrównoważonych inwestycjach

☐ służących celowi środowiskowemu i dokonywanych w działalność gospodarczą, która zgodnie z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju kwalifikuje się jako zrównoważona środowiskowo

☐ służących celowi środowiskowemu i dokonywanych w działalność gospodarczą, która zgodnie z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju nie kwalifikuje się jako zrównoważona środowiskowo

☐ służących celowi społecznemu

☐ Produkt promował aspekty środowiskowe/ społeczne, ale **nie miał udziału w zrównoważonych inwestycjach**

Zrównoważona inwestycja oznacza inwestycję w działalność gospodarczą, która przyczynia się do realizacji celu środowiskowego lub społecznego, o ile taka inwestycja nie wyrządza poważnych szkód względem żadnego celu środowiskowego lub społecznego, a spółki, w które dokonano inwestycji, stosują dobre praktyki w zakresie zarządzania.

Unijna systematyka dotycząca zrównoważonego rozwoju jest to system klasyfikacji określony w rozporządzeniu (UE) 2020/852, ustanawiający wykaz **zrównoważonej środowiskowo działalności gospodarczej**. Rozporządzenie to nie zawiera wykazu

zrównoważonej społecznie działalności gospodarczej. Zrównoważone inwestycje, które służą celowi środowiskowemu, mogą być zgodne lub niezgodne z systematyką.

W jakim stopniu uwzględniono aspekty środowiskowe lub społeczne promowane w ramach tego produktu finansowego?

Produkt (Subfundusz Santander Prestiż Prosperity) może lokować do 100% swoich Aktywów w tytuły uczestnictwa subfunduszu bazowego Santander Prosperity wydzielonego w ramach Santander SICAV (dalej: „Subfundusz Bazowy"), w związku z czym niektóre dalsze informacje dotyczą Subfunduszu Bazowego co każdorazowo zaznaczono.

Ilekroć poniżej jest mowa o:

- Subfunduszu Bazowym – rozumie się przez to Santander Prosperity wydzielony w ramach Santander SICAV,
- Spółce Zarządzającej – rozumie się przez to Santander Asset Management Luxemburg

Subfundusz Bazowy realizował swój cel zrównoważonych inwestycji społecznych, inwestując wyłącznie w spółki, których działalność ukierunkowana jest na trzy obszary tematyczne: Ochrona zdrowia i well-being, Edukacja i przeciwdziałanie finansowemu wykluczeniu oraz Żywność i odżywianie. Te trzy główne wyzwania społeczne, w które Subfundusz inwestował, koncentrowały się przede wszystkim na następujących Celach Zrównoważonego Rozwoju ONZ (SDGs): Koniec z ubóstwem, Dobre zdrowie i jakość życia, Dobra jakość edukacji, Równość płci, Wzrost gospodarczy i godna praca i Mniej nierówności.

Subfundusz Bazowy osiągał swoje cele, inwestując w spółki, które wnoszą pozytywny wkład w nasze społeczeństwo, uzyskując co najmniej 30% swoich przychodów z działalności związanej z wyżej wymienionymi celami zrównoważonego rozwoju. Spółki te kwalifikują się również

Wskaźniki zrównoważonego rozwoju stosuje się do pomiaru stopnia osiągnięcia zrównoważonych celów, którym służy ten produkt finansowy.

jako zrównoważone inwestycje społeczne, ponieważ nie spowodowały żadnych znaczących szkód dla innego zrównoważonego celu i przestrzegały dobrych praktyk zarządzania.

Pozostałe inwestycje, które nie kwalifikowały się jako zrównoważone inwestycje społeczne, nie wpłynęły na osiągnięcie celu Subfunduszu, a ich celem było zapewnienie płynności portfela i zabezpieczenie skutecznego zarządzania ryzykiem stopy procentowej, ryzykiem walutowym i ryzykiem kredytowym. Analizowane czynniki środowiskowe obejmowały ocenę ilościowych i jakościowych wyników emitenta w zakresie zagadnień środowiskowych, takich jak emisja gazów cieplarnianych, wyczerpywanie się zasobów, zanieczyszczenie czy gospodarka wodna.

Jakie osiągnięto wartości wskaźników zrównoważonego rozwoju?

Wartości wskaźników zrównoważonego rozwoju Subfunduszu Bazowego w okresie referencyjnym opisano poniżej:

- Wyłączenia: Subfundusz Bazowy nie obejmował żadnych inwestycji w sektorach niedozwolonych przez jego politykę inwestycyjną. Oznacza to, że Subfundusz Bazowy miał 0% ekspozycji na emitentów, których działalność jest związana z kontrowersyjnymi rodzajami broni, uzbrojeniem, wyrobami tytoniowymi, wydobyciem węgla, energetyką węglową i paliwami kopalnymi, w oparciu o dane dotyczące obrotów.
- Wskaźnik kontrowersji: Subfundusz Bazowy miał 0% ekspozycji na spółki, które były zaangażowane w kontrowersje uznane za krytyczne.
- Procent przychodów dostosowanych do wskaźnika obszarów tematycznych Subfunduszu Bazowego: Subfundusz Bazowy inwestował w spółki, których co najmniej 30% przychodów było związanych z celami zrównoważonego rozwoju w oparciu o informacje dostarczone przez dostawcę danych ESG Spółki Zarządzającej na podstawie analizy operacji, produktów, usług, polityk i praktyk emitentów oraz ich wkładu netto - pozytywnego i negatywnego - w aspekty społeczne Subfunduszu Bazowego lub które, zgodnie z oceną Spółki Zarządzającej, wnosiły istotny wkład w rozwiązywanie wymienionych powyżej wyzwań społecznych, który mógł zostać zwiększony poprzez działania angażujące podejmowane przez Spółkę Zarządzającą wobec odpowiednich spółek.

… a w porównaniu z poprzednimi okresami?

Wyniki wyżej wymienionych wskaźników nie zmieniły się w porównaniu z poprzednim okresem odniesienia:

- Wyłączenia: utrzymały się na poziomie 0%, podobnie jak w poprzednim okresie odniesienia.
- Wskaźnik kontrowersji: utrzymał się na poziomie 0%, podobnie jak w poprzednim okresie odniesienia.
- Odsetek przychodów dostosowanych do tematyki Subfunduszu Bazowego: pozostał na poziomie 30%, tak jak w poprzednim okresie odniesienia.

W jaki sposób zrównoważone inwestycje nie wyrządziły poważnych szkód względem jakiegokolwiek celu dotyczącego zrównoważonych inwestycji?

Aby zagwarantować, że pozytywny wkład w realizację celu społecznego Subfunduszu Bazowego nie zaszkodził znacząco innym celom zrównoważonego rozwoju w okresie odniesienia, Spółka Zarządzająca określiła szereg zabezpieczeń w oparciu o swoją wewnętrzną metodykę, w celu wykazania, że istnieje zamiar niewyrządzania takiej szkody. Zabezpieczenia te obejmują:

- Uwzględnianie głównych wskaźników niekorzystnych skutków (PAI) zawartych w załączniku I do rozporządzenia delegowanego (UE) 2022/1288 uzupełniającego rozporządzenie (UE) 2019/2088 w sprawie ujawniania informacji (SFDR) („RTS"), jak opisano w odpowiedzi na kolejne pytanie.
- Działalność w kontrowersyjnych sektorach: Znaczące ekspozycje na kontrowersyjne rodzaje działalności zostały przeanalizowane i wyłączone w sektorach takich jak paliwa kopalne, kontrowersyjna typy broni, wyroby tytoniowe, a także inwestycje budzące poważne kontrowersje.
- Neutralne wyniki zrównoważone: Minimalna ocena ESG (B) była wymagana zgodnie z wewnętrzną metodyką Spółki Zarządzającej w 7-stopniowej skali (C-, C, C+, B, A-, A i A+, gdzie A+ odzwierciedla najlepsze wyniki ESG), w celu zapewnienia, że praktyki zrównoważonego rozwoju każdego emitenta spełniają minimalne wymogi ESG. Ocena ESG łączy kryteria ilościowe i jakościowe w wymiarze pozytywnym i/lub negatywnym w celu uzyskania przejrzystego i pełnego obrazu wyników każdego aktywa w obszarze ESG i generuje rating ESG w dla każdego typu emitenta.

Jeśli dana inwestycja nie spełnia któregokolwiek z tych zabezpieczeń, Spółka Zarządzająca uznaje, że nie jest możliwe zapewnienie, iż nie wystąpią znaczące szkody i nie zostanie ona uznana za zrównoważoną inwestycję.

Główne niekorzystne skutki to najpoważniejsze niekorzystne skutki decyzji inwestycyjnych dla czynników zrównoważonego rozwoju, takich jak kwestie środowiskowe, społeczne i pracownicze, kwestie dotyczące poszanowania praw człowieka oraz przeciwdziałania korupcji i przekupstwu.

W jaki sposób uwzględniono wskaźniki dotyczące niekorzystnych skutków dla czynników zrównoważonego rozwoju?

Spółka Zarządzająca uwzględniła wszystkie obowiązkowe główne niekorzystne wskaźniki wpływu (PAI) w analizie zgodności z zasadą niepowodowania znaczących szkód (DNSH).

W tym celu Spółka Zarządzająca zdefiniowała odpowiednie progi w oparciu o ilościowe i jakościowe kryteria techniczne. Progi te to:

- Progi bezwzględne: Za niezgodnych z zasadą DNSH uznano emitentów, którzy mają znaczną ekspozycję na paliwa kopalne, prowadzą działalność wpływającą na obszary wrażliwe pod względem bioróżnorodności, naruszają zasady UN Global Compact i Wytyczne Organizacji Współpracy Gospodarczej i Rozwoju (OECD) dla przedsiębiorstw wielonarodowych, nie posiadają procesów i mechanizmów służących monitorowaniu zgodności z tymi międzynarodowymi standardami i/lub są zaangażowani w działalność związaną z kontrowersyjnymi rodzajami broni.
- Progi sektorowe: Przyjmuje się, że emitenci, którzy mieszczą się w zakresie najgorszych wyników w swojej branży pod względem emisji gazów cieplarnianych, wody, odpadów i/lub kwestii społecznych i pracowniczych, nie spełniają

wymogów zasady DNSH.

Czy zrównoważone inwestycje były zgodne z wytycznymi OECD dla przedsiębiorstw wielonarodowych i wytycznymi ONZ dotyczącymi biznesu i praw człowieka? Dodatkowe informacje:

Przestrzeganie dobrych praktyk biznesowych i poszanowanie praw człowieka jest integralnym składnikiem wartości Spółki Zarządzającej i minimalnym standardem działania pozwalającym na prowadzenie działalności w sposób zgodny z prawem.

W tym zakresie, działalność Spółki Zarządzającej opiera się na zasadach wynikających m.in. z Wytycznych OECD dla Przedsiębiorstw Wielonarodowych oraz na dziesięciu zasadach UN Global Compact. Zobowiązanie to znajduje odzwierciedlenie zarówno w politykach korporacyjnych Grupy Santander, jak i w politykach Spółki Zarządzającej, a także jest częścią procedury integracji ryzyka zrównoważonego rozwoju w Spółce Zarządzającej.

Spółka Zarządzająca regularnie monitorowała, czy inwestycje nie naruszały którejkolwiek z międzynarodowych wytycznych. W okresie referencyjnym Subfundusz Bazowy nie inwestował w żadnego emitenta naruszającego wymienione międzynarodowe standardy.

Unijna systematyka dotycząca zrównoważonego rozwoju określa zasadę "nie czyń poważnych szkód" ('Do no significant harm' – DNSH), zgodnie z którą inwestycje zgodne z systematyką nie powinny wyrządzać poważnych szkód względem celów unijnej systematyki dotyczącej zrównoważonego rozwoju, a towarzyszą jej konkretne kryteria unijne.

Zasada "nie czyń poważnych szkód» stosowana jest wyłącznie w odniesieniu do tych inwestycji w ramach produktu finansowego, które uwzględniają unijne kryteria dotyczące zrównoważonej środowiskowo działalności gospodarczej. Inwestycje w ramach pozostałej części tego produktu finansowego nie uwzględniają unijnych kryteriów dotyczących zrównoważonej środowiskowo działalności gospodarczej.

Wszelkie inne zrównoważone inwestycje nie mogą również wyrządzać poważnych szkód względem celów środowiskowych lub społecznych.

Czy w ramach tego produktu finansowego wzięto pod uwagę główne niekorzystne skutki dla czynników zrównoważonego rozwoju?

Subfundusz Bazowy przy podejmowaniu decyzji inwestycyjnych brał pod uwagę główne niekorzystne skutki dla czynników zrównoważonego rozwoju (PAI). W tym celu monitorowano wskaźniki obowiązkowe z Tabeli 1 oraz dwa opcjonalne wskaźniki z Tabel 2 i 3 z Załącznika nr 1 do Regulacyjnych Standardów Technicznych (RTS) do rozporządzenia SFDR celem dokonania oceny zewnętrznych niekorzystnych skutków, jakie mogłyby wywołać inwestycje tego Subfunduszu.

W okresie referencyjnym Spółka Zarządzająca identyfikowała te wpływy na dwóch poziomach:

- Na podstawie wyników każdego emitenta względem branży, identyfikując w ten sposób spółki o najsłabszych wynikach w zakresie każdego wskaźnika PAI. Następnie, emitenci z gorszymi wynikami w porównaniu z ich sektorem w odniesieniu do wszystkich obowiązkowych wskaźników PAI byli wykluczani z Subfunduszu Bazowego.
- Na podstawie porównania wyników wskaźników PAI subfunduszy z wynikami indeksu referencyjnego (benchmarku). Gdy wyniki danego subfunduszu były gorsze niż benchmark, Spółka Zarządzająca analizowała istotność wpływu, powtarzalność w czasie, prawdopodobieństwo uzyskania pozytywnych wyników poprzez działania angażujące, ekspozycję portfela i typologię wskaźników PAI w celu wdrożenia działań angażujących. W okresie referencyjnym priorytetem tych działań były wskaźniki związane z emisją gazów cieplarnianych. Ponadto Spółka Zarządzająca łagodziła również te skutki, dostosowując pozycje, które w największym stopniu przyczyniają się do słabszych wartości wskaźnika PAI w porównaniu z jego benchmarkiem, ograniczając wzrost pozycji lub ostatecznie dokonując dezinwestycji.

Dane wymagane do analizy wskaźników PAI zostały dostarczone przez zewnętrznych dostawców danych. Przeprowadzono regularną analizę zakresu i jakości danych, we współpracy z emitentami i dostawcami danych, w celu wyeliminowania ograniczeń w dostępności i jakości danych we wskaźnikach.

Jakie główne inwestycje obejmuje ten produkt finansowy?

Wykaz zawiera inwestycje stanowiące **największą część inwestycji** w ramach tego produktu finansowego w okresie odniesienia od 01/01/2023 do 31/12/2023

Największe inwestycje	Sektor	% aktywów	Państwo
SANTANDER PROSPERITY	-	91,12%	Luksemburg
POLGB F 01/25/26 0126	Obligacje państwowe	2,75%	Polska

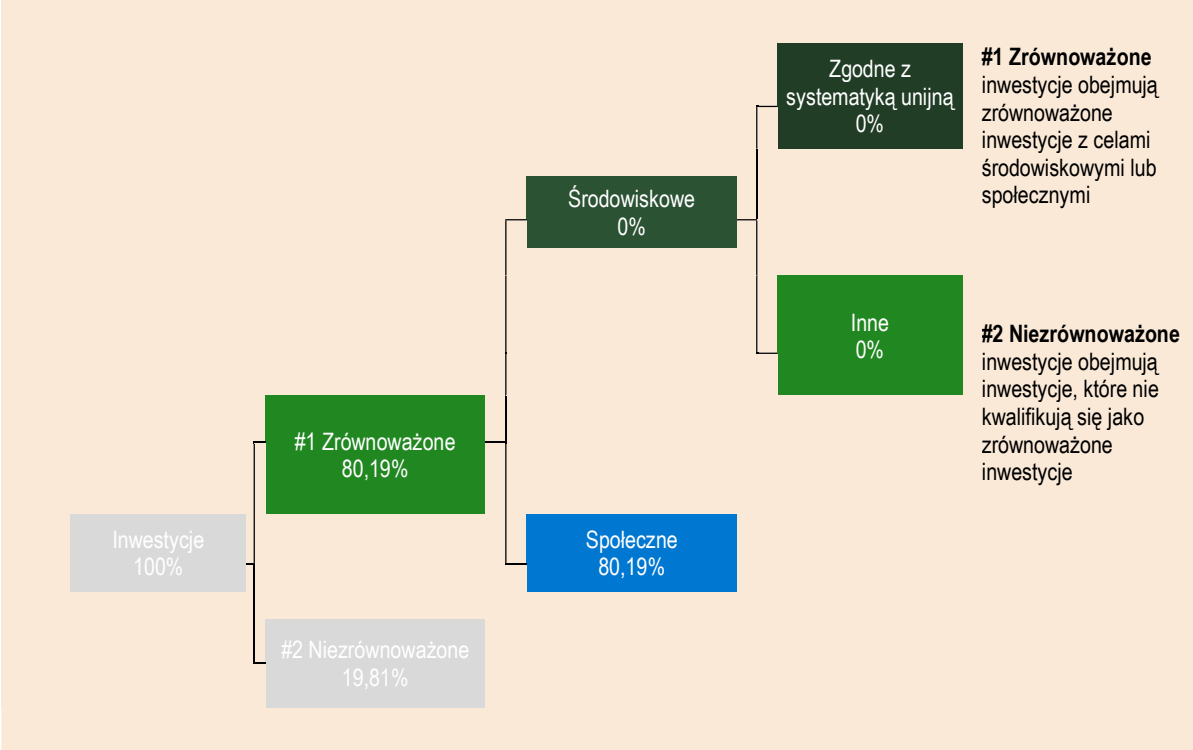
Jaki był udział inwestycji związanych ze zrównoważonym rozwojem?

Udział inwestycji związanych ze zrównoważonym rozwojem wynosi co najmniej 70% aktywów Funduszu.

Jak przedstawiała się alokacja aktywów?

Subfundusz przestrzegał alokacji aktywów podanej w informacjach udzielonych przed zawarciem umowy. Subfundusz spełnia kryterium minimalnego poziomu 70% zrównoważonych inwestycji, co w pełni odpowiada inwestycjom zrównoważonym społecznie. Odsetek społecznie zrównoważonych inwestycji tego Subfunduszu wynosi 80,19% ogółu aktywów Subfunduszu. Odsetek ten został obliczony jako średni udział zrównoważonych inwestycji Subfunduszu, biorąc pod uwagę dane z ostatniego dnia roboczego każdego kwartału okresu referencyjnego, jak wskazano w sekcji Największe inwestycje.

Alokacja aktywów ukazuje udział inwestycji w poszczególne aktywa.



W których sektorach gospodarki dokonano inwestycji?

Inwestycje Subfunduszu Bazowego.

Sektor gospodarki	Podsektor	Udział
Branża spożywcza		**14,07%**
	Pakowana żywność i mięso	89,03%
	Produkty i usługi rolnicze	10,97%
Branża farmaceutyczna		**13,67%**
	Produkty farmaceutyczne	100,00%
Urządzenia i materiały dla służby zdrowia		**9,26%**
	Sprzęt medyczny	96,59%
	Zaopatrzenie służby zdrowia	3,41%
Usługi konsumenckie o zróżnicowanym profilu		**7,50%**
	Usługi edukacyjne	100,00%
Produkty dla gospodarstw domowych		**5,89%**
	Produkty dla gospodarstw domowych	100,00%
Biotechnologia		**4,55%**
	Biotechnologia	100,00%
Inne		**4,32%**
	Inne	100,00%
Zarządzanie nieruchomościami i działalność deweloperska		**3,23%**
	Spółki operujące na rynku nieruchomości	100,00%
Fundusze REIT - opieka zdrowotna		**3,08%**
	Fundusze REIT - ochrona zdrowia	100,00%
Papier i produkty leśne		**3,05%**
	Produkty papiernicze	100,00%
Dostawy energii elektrycznej		**3,00%**
	Dostawcy energii elektrycznej	100,00%
Fundusze REIT mieszkaniowe		**2,98%**
	Fundusze REIT - mieszkaniowe, wielorodzinne	54,50%
	Jednorodzinne REIT-y mieszkaniowe	45,50%
Maszyny		**2,95%**
	Maszyny przemysłowe, materiały eksploatacyjne i komponenty	52,16%
	Maszyny budowlane i ciężki sprzęt transportowy	47,84%
Półprzewodniki i urządzenia półprzewodnikowe		**2,18%**
	Półprzewodniki	100,00%
Oprogramowanie		**1,62%**
	Oprogramowanie użytkowe	100,00%
Finanse konsumenckie		**1,60%**
	Finanse konsumenckie	100,00%
Przedsiębiorstwa wodociągowe		**1,56%**
	Branża wodno-kanalizacyjna	100,00%
Produkty budowlane		**1,55%**
	Produkty budowlane	100,00%
Fundusze REIT przemysłowe		**1,53%**
	Fundusze REIT przemysłowe	100,00%
Branża chemiczna		**1,50%**
	Specjalistyczne substancje chemiczne	100,00%
Narzędzia i usługi dla sektora Life Sciences		**1,49%**
	Narzędzia i usługi dla branży Life Sciences	100,00%

Produkty higieny osobistej		**1,46%**
	Produkty higieny osobistej	100,00%
Rozrywka		**1,46%**
	Interaktywna rozrywka domowa	100,00%
Fundusze REIT detaliczne		**1,30%**
	Fundusze REIT detaliczne	100,00%
Sprzęt elektryczny		**1,25%**
	Komponenty i sprzęt elektryczny	100,00%
Transport naziemny		**1,13%**
	Transport kolejowy	100,00%
Banki komercyjne		**1,10%**
	Banki zdywersyfikowane	100,00%
Usługi telekomunikacji bezprzewodowej		**0,70%**
	Usługi telekomunikacji bezprzewodowej	100,00%
Dostawcy i usługi opieki zdrowotnej		**0,38%**
	Dystrybutorzy opieki zdrowotnej	100,00%
Usługi IT		**0,34%**
	Doradztwo IT i inne usługi	100,00%
Usługi komercyjne i zaopatrzenie		**0,33%**
	Usługi środowiskowe i związane z infrastrukturą	100,00%

W jakim stopniu zrównoważone inwestycje służące realizacji celu środowiskowego były dostosowane do unijnej systematyki dotyczącej zrównoważonego rozwoju?

Aby zapewnić zgodność z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju, kryteria dotyczące **gazu ziemnego** obejmują ograniczenia emisji i przejście na energię ze źródeł odnawialnych lub paliwa niskoemisyjne do końca 2035 r. W przypadku **energii jądrowej** kryteria te obejmują kompleksowe zasady w zakresie bezpieczeństwa i gospodarowania odpadami.

Działalność wspomagająca bezpośrednio wspomaga inne rodzaje działalności we wnoszeniu istotnego wkładu w realizację celu środowiskowego.

Działalność na rzecz przejścia jest to działalność, dla której alternatywne niskoemisyjne rozwiązania nie są jeszcze dostępne i która między innymi wytwarza emisje gazów cieplarnianych na poziomie odpowiadającym najlepszym wynikom.

Działalność zgodna z systematyką jest wyrażona jako udział:

- obrotu, który odzwierciedla udział przychodów z działalności ekologicznej spółek, w które dokonano inwestycji;

-nakładów inwestycyjnych (CapEx), które ukazują zielone inwestycje dokonane przez spółki, w które dokonano inwestycji, np. w celu przejścia na zieloną gospodarkę;

-wydatków operacyjnych (OpEx), które odzwierciedlają ekologiczną działalność operacyjną spółek, w które dokonano inwestycji.

Subfundusz nie ustalił minimalnego procentowego stopnia dostosowania swoich inwestycji do systematyki UE. Poniższe wykresy przedstawiają dostosowanie portfela do systematyki UE jako średni procent aktywów Subfunduszu biorąc pod uwagę inwestycje bazowe z ostatniego dnia roboczego każdego kwartału okresu referencyjnego, jak wskazano w sekcji Największe inwestycje.

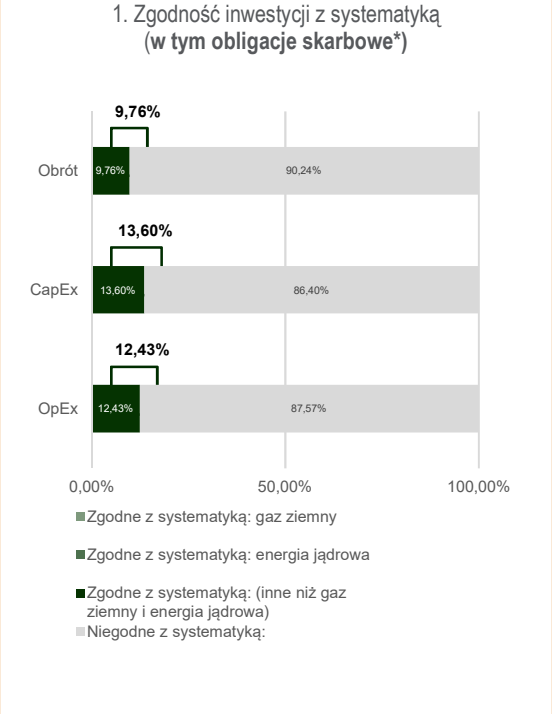
Czy w ramach produktu finansowego inwestowano w działalność związaną z gazem ziemnym lub energią jądrową, która jest zgodna z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju[1]?

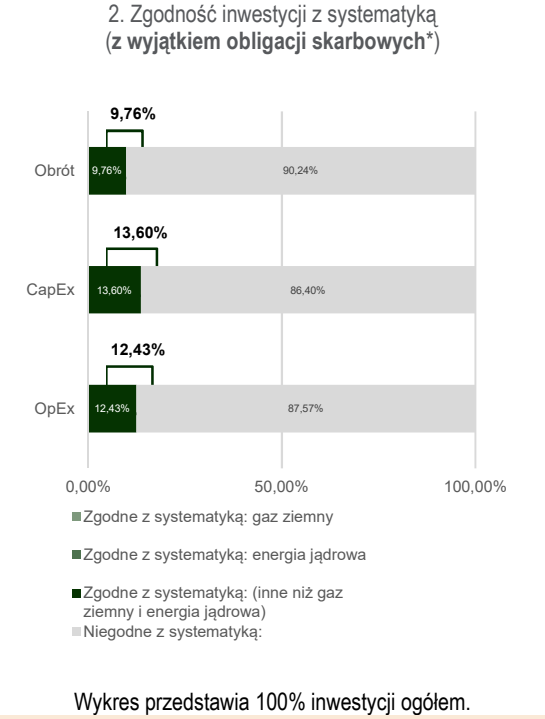
☐ Tak

☐ w gaz ziemny ☐ w energię jądrową

☒ Nie

Na dwóch wykresach poniżej przedstawiono na zielono minimalny odsetek inwestycji zgodnych z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju. Ponieważ brak jest odpowiednich metod umożliwiających określenie zgodności obligacji skarbowych z systematyką, na pierwszym wykresie przedstawiono zgodność z systematyką w odniesieniu do wszystkich inwestycji w ramach produktu finansowego, w tym obligacji skarbowych, natomiast na drugim wykresie przedstawiono zgodność z systematyką wyłącznie w odniesieniu do inwestycji w ramach produktu finansowego innych niż obligacje skarbowe.*





Wykres przedstawia 100% inwestycji ogółem.

** Dla celów niniejszych wykresów „obligacje skarbowe" obejmują całe zaangażowanie w dług państwowy.*

Jaki był udział inwestycji w działalność na rzecz przejścia i działalność wspomagającą?

Portfel Subfunduszu Bazowego jest w 0,01% dostosowany do systematyki UE poprzez działalność na rzecz przejścia, a w 2,08% poprzez działalność wspomagającą.

[1] Działalność związana z gazem kopalnianym i/lub energią jądrową będzie zgodna z unijną systematyką tylko wtedy, gdy przyczyni się do ograniczenia zmian klimatycznych ("łagodzenie zmian klimatycznych") i nie zaszkodzi znacząco żadnemu celowi unijnej systematyki - patrz wyjaśnienie na lewym marginesie. Pełne kryteria dotyczące działalności gospodarczej związanej z gazem kopalnianym i energią jądrową, która jest zgodna z unijną systematyką, zostały określone w rozporządzeniu delegowanym Komisji (UE) 2022/1214.

Jak w porównaniu z poprzednimi okresami odniesienia kształtował się odsetek inwestycji zgodnych z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju?

Subfundusz Bazowy nie określił minimalnego odsetka swoich inwestycji zgodnych z systematyką UE. Odsetek inwestycji dostosowanych do systematyki UE w porównaniu z poprzednim okresem referencyjnym wzrósł w oparciu o 3 wykresy systematyki UE (obrót: 0,60%, nakłady inwestycyjne (CapEx): 1,24% i nakłady operacyjne (OpEx): 0,90%).

to zrównoważone inwestycje służące celowi środowiskowemu, które **nie uwzględniają kryteriów** zrównoważonej środowiskowo działalności gospodarczej na podstawie unijnej systematyki

Jaki był udział zrównoważonych inwestycji służących celowi środowiskowemu, które nie są zgodne z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju?

Subfundusz nie dokonał żadnych zrównoważonych inwestycji o celu środowiskowym.

Jaki był udział zrównoważonych inwestycji służących celowi społecznemu?

Udział inwestycji o celu społecznym Subfunduszu wyniósł 80,19%.

Jakie inwestycje uwzględniono w kategorii #2 „Niezrównoważone", czemu służyły takie inwestycje i czy w ich ramach zapewniono jakiekolwiek minimalne zabezpieczenia środowiskowe lub społeczne?

Subfundusz miał średnio 19,81% udziału inwestycji, które nie kwalifikowały się jako zrównoważone inwestycje w całym okresie odniesienia. Inwestycje te ujęte w pozycji "#2 Niezrównoważone" nie wpłynęły na osiągnięcie celu zrównoważonego inwestowania Subfunduszu, a ich celem jest zapewnienie płynności portfela i zabezpieczenie skutecznego zarządzania ryzykiem stopy procentowej, walutowym i kredytowym.

Jakie działania podjęto, aby osiągnąć cel dotyczący zrównoważonych inwestycji w okresie odniesienia?

W okresie odniesienia podjęto następujące działania, aby zapewnić realizację zrównoważonego celu inwestycyjnego Subfunduszu:

- Spółka Zarządzająca określiła społecznie zrównoważone uniwersum inwestycyjne Subfunduszu Bazowego poprzez okresową selekcję spółek, których działalność biznesowa ma na celu generowanie pozytywnych społecznych efektów i które wnoszą wkład w obszary tematyczne Subfunduszu Bazowego: Zdrowie i well-being, Edukacja i przeciwdziałanie wykluczeniu finansowemu oraz Żywność i odżywianie. W tym celu, Zarządzający sprawdził, czy każda kwalifikująca się spółka posiada co najmniej 30% przychodów związanych z celami zrównoważonego rozwoju dotyczącymi obszarów tematycznych Subfunduszu Bazowego, lub czy zgodnie z oceną Zarządzającego wnosi istotny wkład w rozwiązywanie wyzwań z obszarów tematycznych Subfunduszu Bazowego.
- Spółka Zarządzająca okresowo weryfikowała zgodność Subfunduszu Bazowego z następującymi wyłączeniami:
    - Emitenci, którzy prowadzili jakąkolwiek działalność gospodarczą (mierzoną obrotami) związaną z kontrowersyjnymi rodzajami broni, uzbrojeniem, wydobyciem węgla oraz wytwarzaniem energii z węgla i gazu ziemnego, zostali wykluczeni.
    - Emitenci zaangażowani w kontrowersje uznane za krytyczne zostali wykluczeni z uniwersum inwestycyjnego Subfunduszu Bazowego.
    - Emitenci, których działalność mogła mieć znaczący negatywny wpływ na czynniki zrównoważonego rozwoju według metodyki Spółki Zarządzającej, które nie zostały ograniczone poprzez podjęte działania angażujące, zostali wykluczeni.
    - Emitenci o słabych wynikach w zakresie ładu korporacyjnego według metodyki oceny ESG Spółki Zarządzającej zostali wykluczeni, aby zagwarantować odpowiednie praktyki w zakresie zarządzania.

Powyższe kryteria ESG wraz ze zgodnością z minimalnymi zobowiązaniami Subfunduszu Bazowego zostały włączone do procesu inwestycyjnego i były regularnie monitorowane przez zespół ds. zapewnienia zgodności (Compliance) Spółki Zarządzającej, a w przypadku jakiejkolwiek niezgodności podejmowano niezbędne działania naprawcze (na przykład raport do zespołu zarządzającego, komunikacja z zespołem SRI, skierowanie do odpowiedniego komitetu).

Ponadto wyniki emitentów w zakresie ESG podlegały systematycznemu i ciągłemu monitorowaniu przez zespół SRI Spółki Zarządzającej, w tym nieustannemu monitorowaniu potencjalnych rozbieżności zidentyfikowanych przez Zarządzających portfelem pomiędzy wiedzą o emitencie a danymi zawartymi w modelu dostarczonym przez dostawców.

Spółka Zarządzająca podejmowała również działania angażujące wobec prywatnych emitentów oraz działania związane z prawem głosu w przypadkach, gdy pozwalał na to rodzaj aktywów (akcje). Działania te były zgodne ze zrównoważonym celem Subfunduszu Bazowego oraz z obowiązującą Polityką Zaangażowania i Wykonywania Prawa Głosu Spółki Zarządzającej, która jest dostępna pod adresem https://www.santanderassetmanagement.lu/document-library/policies. Inne przykłady działań związanych z zaangażowaniem i wykonywaniem prawa głosu można znaleźć w Raporcie Spółki Zarządzającej dostępnym pod adresem: https://www.santanderassetmanagement.com/sustainability.

Jakie wyniki uzyskano w ramach tego produktu finansowego w porównaniu ze wskaźnikiem referencyjnym?

Wskaźniki referencyjne to indeksy stosowane do pomiaru, czy w ramach produktu finansowego uwzględnia się aspekty środowiskowe lub społeczne promowane przez ten produkt.

Nie został wyznaczony żaden indeks jako wskaźnik referencyjny dla celów osiągnięcia aspektów środowiskowych lub społecznych promowanych przez ten produkt finansowy.

W jaki sposób wyznaczony wskaźnik referencyjny różni się od ogólnego indeksu rynkowego?

Nie dotyczy

Jakie wyniki uzyskano w ramach tego produktu finansowego pod względem wskaźników zrównoważonego rozwoju służących do ustalenia stopnia dostosowania danego wskaźnika referencyjnego do promowanych aspektów środowiskowych lub społecznych?

Nie dotyczy

Jakie wyniki uzyskano w ramach tego produktu finansowego w porównaniu ze wskaźnikiem referencyjnym?

Nie dotyczy

Jakie wyniki uzyskano w ramach tego produktu finansowego w porównaniu z ogólnym indeksem rynkowym?

Nie dotyczy