

Document de synthèse

Robeco Capital Growth Funds - Robeco QI Global Momentum Equities

Ce produit financier favorise des caractéristiques environnementales ou sociales, mais n'a pas pour objectif l'investissement durable.

Le Sous-fonds présente les caractéristiques E/S suivantes :

1. Le Sous-fonds favorise certaines garanties environnementales et sociales minimales en appliquant des critères d'exclusion concernant les produits et pratiques commerciales que Robeco juge préjudiciables à la société, comme l'exposition à des comportements controversés, à des armes controversées et à certaines activités liées aux combustibles fossiles.
2. Le Sous-fonds s'efforce d'avoir une empreinte carbone inférieure à celle de l'indice général de marché mentionné à l'Annexe VI – Indices de référence (l'« indice général de marché »).
3. Le Sous-fonds s'efforce d'avoir une empreinte environnementale inférieure à celle de l'indice général du marché.
4. Le Sous-fonds encourage l'adhésion à la Déclaration universelle des droits de l'homme des Nations Unies, aux normes du travail de l'Organisation internationale du travail (OIT), aux Principes directeurs des Nations Unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme (PNG), au Pacte mondial des Nations Unies (PNG) et aux Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales, ainsi que la conduite d'activités commerciales dans le respect de ces principes, en examinant de près les entreprises qui violent ces principes.
5. Le Sous-fonds s'efforce d'avoir un score ESG moyen pondéré supérieur à celui de l'indice général du marché.
6. Le Sous-fonds s'efforce d'avoir en portefeuille une part plus importante de sociétés affichant un score ODD positif (1, 2, 3) que l'indice général du marché.

Aucun indice de référence n'a été désigné dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales favorisées par le Sous-fonds.

Stratégie d'investissement

Robeco QI Global Momentum Equities est un fonds à gestion active qui investit dans des actions de pays développés et émergents du monde entier. La sélection de ces titres est basée sur un modèle quantitatif comme l'indique le paragraphe de la stratégie sur la Politique d'investissement en Annexe I du présent prospectus.

La stratégie intègre en continu des indicateurs de durabilité dans le cadre de son processus de sélection de titres. Le Sous-fonds applique notamment des exclusions basées sur des normes et activités, la politique de bonne gouvernance de Robeco, le cadre ODD de Robeco et tient compte des Principales incidences négatives (« Principal Adverse Impacts ») dans son processus d'investissement. Des informations plus spécifiques aux produits sont disponibles sur notre site web et via les liens fournis dans la question finale de la présente publication.

Indice de référence

Non applicable.

Allocation d'actifs prévue

Le produit prévoit de réaliser un montant minimum de 50 d'investissements durables. Tous les investissements sont alignés sur les caractéristiques E/S, à l'exception des investissements de la catégorie « autres » qui concernent principalement le cash et des équivalents cash.

Suivi et due diligence

Robeco a intégré les aspects de durabilité des stratégies d'investissement dans des processus et procédures de due diligence adéquats pour la sélection et le suivi des investissements, en tenant compte notamment de l'appétit pour le risque et des politiques de gestion du risque de durabilité de Robeco. Les gérants de portefeuille et les analystes sont principalement responsables de l'application de la due diligence en matière d'investissement pour leurs stratégies au quotidien. Ils sont soutenus par un suivi indépendant, effectué par les départements de la gestion des risques financiers et des restrictions d'investissement.

Sources de données, méthodologies et limitations

Le produit utilise plusieurs sources pour recueillir des données sur la durabilité. Robeco examine minutieusement la qualité des données de chaque fournisseur lors des évaluations de due diligence, ce qui inclut l'examen du modèle de données, la réalisation de contrôles statistiques et l'évaluation de la couverture. Le traitement des données se fait sous différentes formes, la préférence allant toujours à une acquisition des données aussi automatisée que possible afin d'éviter tout risque opérationnel ou toute intervention humaine inutile.

Robeco maintient des documents méthodologiques complets sur ses cadres analytiques propriétaires sur son site web. En outre, pour certaines caractéristiques sociales et environnementales, Robeco s'appuie sur un contenu provenant de sources externes, pour lequel

nous cherchons à sélectionner le meilleur fournisseur pour chacune de nos caractéristiques cibles. La principale limitation de la méthodologie ou de la source de données est le manque d'informations communiquées par les entreprises. Comme de nombreux autres acteurs du marché financier, nous avons du mal à trouver des informations adéquates sur les principaux indicateurs défavorables. Pour surmonter ce problème, Robeco a recours à plusieurs fournisseurs de données, car chacun a ses propres forces et faiblesses.

Stratégie d'engagement

Les positions du fonds sont soumises au processus de sélection du programme d'engagement (ou dialogue actionnarial) de Robeco, qui consiste à établir un dialogue constructif entre les investisseurs et les entreprises détenues afin d'aborder la manière dont elles gèrent les risques et les opportunités ESG, ainsi que l'impact sur les parties prenantes. Bien que ce type de dialogue actionnarial ne soit pas directement lié à la stratégie d'investissement environnementale ou sociale du fonds, il se peut que des impacts négatifs sur la durabilité soient abordés par le biais du programme d'engagement.