



Samenvattend document

Robeco Capital Growth Funds - Robeco QI US Beta Equities

Dit financiële product bevordert milieu- of sociale kenmerken, maar heeft duurzaam beleggen niet als doel.

Het Subfonds heeft de volgende E/S-kenmerken:

1. Het Subfonds streeft naar een fors kleinere CO₂-voetafdruk van bedrijven dan de Algemene Marktindex.
2. Het Subfonds streeft naar een aanzienlijk kleinere water- en afvalvoetafdruk dan de Algemene Marktindex.
3. Het Subfonds bevordert bepaalde minimale milieu- en maatschappelijke waarborgen door uitsluitingscriteria toe te passen voor producten en werkwijzen die volgens Robeco een negatieve impact hebben op de maatschappij, zoals beleggingen in controversieel gedrag, controversiële wapens en fossiele brandstoffen.
4. Het Subfonds heeft een aanzienlijk betere gewogen gemiddelde ESG-score dan de Algemene Marktindex.
5. Het Subfonds bevordert een groter aandeel bedrijven met een positieve SDG-score (1,2,3) in de portefeuille dan de Algemene Marktindex.
6. Het Subfonds bevordert beleggingen in bedrijven die beter scoren dan -3 op het intern ontwikkelde SDG Framework.

Er is geen referentie-index die is bedoeld om de milieu- en maatschappelijke kenmerken te realiseren die worden bevorderd door het Subfonds.

Beleggingsstrategie

Robeco QI US Beta Equities is een actief beheerd fonds dat belegt in aandelen van bedrijven uit de VS. De selectie van deze aandelen is gebaseerd op een kwantitatief model zoals beschreven in de paragraaf over de strategie voor het beleggingsbeleid in Bijlage I van dit prospectus.

Beta staat voor de beleggingsbenadering van het Subfonds die als enige doel heeft het nastreven van de duurzame beleggingsdoelstellingen van het Subfonds. De strategie integreert duurzaamheidsindicatoren voortdurend in het aandelenselectieproces. Het Subfonds hanteert onder meer uitsluitingen op basis van normen en activiteiten, Robeco's SDG Framework en Robeco's beleid voor goede governance en het houdt rekening met belangrijke negatieve impact in het beleggingsproces.

Benchmark

Niet van toepassing.

Geplande assetallocatie

Het product wil minimaal 60% duurzame beleggingen doen. Alle beleggingen zijn in overeenstemming met de E/S-kenmerken, met uitzondering van de beleggingen in de categorie 'overige', die meestal uit liquide middelen bestaan.

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.

Gegevensbronnen, methodologieën en beperkingen

Het product 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 milieukenmerken 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. Meer informatie is te vinden in Robeco's Stewardshipbeleid [Robeco's Stewardship Policy](#).