

DJE – Zins & Dividende LEI: 5299007DOQFQYF3G6D66

Resumo

1. Produto sem objetivo de investimento sustentável

Este produto financeiro promove características ambientais ou sociais, mas não tem como objetivo o investimento sustentável.

O Subfundo tem como objetivo atingir uma quota mínima de 10% dos ativos do Subfundo em investimentos sustentáveis, na aceção do art. 2.º, n.º 17, do Regulamento relativo à divulgação de informações.

O Gestor do Fundo prossegue uma abordagem "best-in-class", tendo em conta a exclusão de empresas que violam determinados princípios, por forma a reduzir potenciais impactos ambientais e sociais negativos.

Os principais impactos negativos (os designados "principle adverse impacts" ("PAI's")) das decisões de investimento sobre os fatores de sustentabilidade são tidos em conta para este Subfundo?

Sim

Não

2. Características ambientais ou sociais do produto financeiro

Critérios de exclusão

Integração ESG

Investimentos sustentáveis

[outros]

3. Estratégia de investimento

Além dos requisitos seguintes, a composição dos ativos do Subfundo é concretizada de forma ativa e independente de quaisquer especificações relativas ao índice de referência, setor, país, maturidade, notação e capitalização bolsista, tendo em conta os fatores ESG e os impactos negativos da sustentabilidade nos fatores de sustentabilidade. Para atingir os objetivos de investimento, pelo menos 50% dos ativos do Subfundo são investidos mundialmente em obrigações de todos os tipos - incluindo obrigações de cupão zero e títulos de juro variável, obrigações indexadas à inflação, certificados de participação e obrigações convertíveis e obrigações com *warrants* (até um máximo de 25% dos ativos do Subfundo) cujos *warrants* sejam denominados em valores mobiliários - cotadas numa bolsa de valores ou negociadas noutro mercado regulamentado que opere regularmente, seja reconhecido e aberto ao público. Os títulos acima referidos de emitentes dos mercados emergentes estão limitados a 25% dos ativos do Subfundo. Além disso, no mínimo 25% e no máximo 50% dos ativos do Subfundo são investidos em ações a nível mundial. Os títulos acima referidos de emitentes dos mercados emergentes estão limitados a 25% dos ativos do Subfundo. O prospeto de venda do Subfundo contém informações pormenorizadas sobre a política de investimento do Subfundo.

4. Proporção dos investimentos

O Subfundo tem como objetivo atingir uma quota mínima de 10% dos ativos do Subfundo em investimentos sustentáveis, na aceção do art. 2.º, n.º 17, do Regulamento relativo à divulgação de informações.

Pelo menos 65% dos ativos do Subfundo têm de ser investidos em títulos com uma classificação ESG da MSCI ESG Research LLC de, no mínimo, BB.

Outros investimentos (incluindo depósitos bancários, derivados, etc.) estão limitados a 35%.

5. Monitorização das características ambientais ou sociais

O cumprimento das exclusões e das quotas mínimas indicadas em "Estratégia de investimento" e "Descrição das características ambientais ou sociais" é verificado no processo de pré-negociação através de listas negativas e positivas, as quais são armazenadas no sistema de gestão de ordens e atualizadas, no mínimo, trimestralmente. No processo pós-negociação, os dados são atualizados semanalmente pela MSCI ESG Research LLC. Em seguida, são apresentados os indicadores de sustentabilidade integrados no processo de investimento:

Critérios de exclusão

Integração ESG

Investimentos sustentáveis

[outros]

6. Metodologias relativas às características ambientais ou sociais

As metodologias utilizadas pelo Subfundo para verificar a abordagem "best-in-class" descrita e as exclusões enumeradas são as seguintes. Para as exclusões, são criadas listas negativas com base nos dados da MSCI ESG Research LLC:

Critérios de exclusão

Os critérios de exclusão definidos são verificados utilizando campos de dados externos para todos os investimentos da carteira (lista negativa).

Integração ESG

O Gestor do Fundo prossegue uma abordagem "best-in-class", tendo em conta a exclusão de empresas que violam determinados princípios, por forma a reduzir potenciais impactos ambientais e sociais negativos.

Investimentos sustentáveis

Como parte da análise para determinar se um título individual se qualifica como investimento sustentável, é efectuado um teste "não prejudicar significativamente" (DNSH), uma contribuição positiva para um objetivo ambiental ou social e uma boa governação empresarial, utilizando vários campos de dados fornecidos pela MSCI ESG Research LLC.

7. Fontes e tratamento dos dados

No âmbito da abordagem "best-in-class", as potenciais empresas são avaliadas utilizando uma metodologia de classificação interna baseada em dados ESG externos (MSCI ESG Research LLC.), assim como nos nossos próprios resultados de *research*. Em caso de dúvida, o Gestor do Fundo pode submeter os dados disponíveis à apreciação de um comité.

8. Limitações da metodologia e dos dados

Os métodos e dados são limitados uma vez que os dados podem não estar disponíveis ou não ser fornecidos para todos os títulos. Além disso, os dados relativos a um único emitente podem não estar disponíveis em quantidade suficiente. Estes dados podem ainda basear-se em estimativas.

Os títulos sem dados inserem-se na categoria de "outros investimentos", que não podem representar mais de 35% dos ativos do Subfundo. Esta categoria inclui igualmente depósitos bancários e instrumentos derivados.

9. Verificação dos investimentos (diligência devida)

O Subfundo está sujeito ao processo de investimento do Gestor do Fundo:

1/ Seleção de títulos: O processo de seleção de títulos inclui as categorias avaliação de analistas, debate com as empresas, critérios de sustentabilidade/ESG, avaliação, momentum, bem como segurança e liquidez. Em cada categoria é atribuída uma pontuação que varia entre -10 e +10, sendo -10 a classificação mais baixa e +10 a classificação mais alta. Todas as seis categorias têm igual peso no processo normalizado.

2/ Exclusões: Os critérios de exclusão aplicados reduzem o universo potencial de investimento.

10. Política de envolvimento

A política de envolvimento da DJE Investment S.A. pode ser consultada gratuitamente pelos investidores no website www.dje.lu, na secção "Informações legais".

11. Índice de referência designado

Não foi determinado um valor de referência para o Subfundo a fim de determinar se este produto financeiro está em conformidade com as características ambientais e/ou sociais divulgadas.

Para informações detalhadas, consultar o documento global "Informações relacionadas com a sustentabilidade Transparência da promoção de características ambientais ou sociais", publicado em <https://www.dje.de/transparenz-bei-dje-zins-und-dividende>.