

PRANEŠIMAS APIE TVARUMO RIZIKOS INTEGRAVIMĄ Į INVESTICINIUS SPRENDIMUS

Šiame pranešime valdymo įmonė UAB „Investicijų valdymas Prosperus“ (toliau – Valdymo įmonė) pateikia su tvarumu susijusią informaciją, kaip tai nustatyta 2019 m. lapkričio 27 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamente (ES) 2019/2088 dėl su tvarumu susijusios informacijos atskleidimo finansinių paslaugų sektoriuje (toliau – Reglamentas).

Tvarumo veiksniai (angl. *Environmental, social, and governance (ESG)*) suprantami kaip aplinkos, socialiniai ir darbuotojų klausimai, taip pat pagarbos žmogaus teisėms ir kovos su korupcija bei kovos su kyšininkavimu klausimai, o tvarumo rizika – kaip su tvarumo veiksniais susijęs įvykis ar situacija, kuriai įvykus galėtų būti padarytas realus ar galimas reikšmingas neigiamas poveikis investicijų vertei.

Valdymo įmonė, priimdama investicinius sprendimus dėl Bendrovės turto investavimo, vertina konkrečiai investicijai aktualias tvarumo sritis, susijusias su investicijos tvarumu, etiniu, socialiniu ir aplinkosauginiu poveikiu. Taip pat Valdymo įmonė įsipareigoja apsvarstyti esminius tvarumo aspektus atliekant investicijas, vykdant investicijų išsamų patikrinimą ir stebint bei vertinant valdomas Bendrovės investicijas tiek, kiek tai yra praktiška atsižvelgiant į aplinkybes ir Valdymo įmonės įsipareigojimą siekti investuotojams uždirbti geriausią įmanomą grąžą ir visada veikti geriausiaisiais jų interesais.

Valdymo įmonė, priimdama ir vykdydama investicinius sprendimus dėl jos valdomų informuotiesiems investuotojams skirtų kolektyvinio investavimo subjektų (toliau – IISKIS) turto pagal kiekvieno IISKIS steigimo dokumentuose numatytą investavimo strategiją, vadovaujasi vidiniais dokumentais, reglamentuojančiais investicinių sprendimų priėmimą ir investavimo rizikos valdymą. Vadovaudamasi nurodytais vidiniais dokumentais, Valdymo įmonė, prieš priimdama investicinį sprendimą dėl IISKIS turto investavimo, atsižvelgia į numatomos investicijos pobūdį bei atlieka analizę, susijusią su atitinkamos investicijos įtaka IISKIS sudarančiam turtui, jo likvidumui bei rizikos ir grąžos pobūdžiui.

Valdymo įmonė yra patvirtinusi Tvarumo politiką (toliau - Politika), kurios pagrindinis tikslas apibrėžti Bendrovės požiūrį į su tvarumu susijusias rizikas bei neigiamą poveikį tvarumui, kurios gali pasireikšti valdant kolektyvinio investavimo subjektus (toliau – Fondus) priimant investicinius sprendimus. Politikoje numatomi pagrindiniai kriterijai, kuriais Valdymo įmonė apsibrėžia, kaip yra integruojama tvarumo rizika, kokie pagrindiniai kriterijai yra analizuojami susiję su tvarumu. Valdymo įmonė atsižvelgia į esminius tvarumo aspektus atliekant investicijas, vykdant investicijas tiek, kiek tai yra praktiška atsižvelgiant į aplinkybes ir Valdymo įmonės tikslus siekiant atstovauti geriausiems Fondų investuotojų interesams.

Detalesnę informaciją apie tvarumo rizikos integravimą į investicinių sprendimų priėmimo procesą nurodoma Valdymo įmonės patvirtintoje Tvarumo politikoje, kuri skelbiama Valdymo įmonės interneto svetainėje www.prosperus.com, arba pateikiama fondo steigimo dokumentuose su kita tvarumo informacija.

GALIMO TVARUMO RIZIKOS POVEIKIO GRĄŽAI VERTINIMAS

Tvarumo rizika gali pasireikšti per įvairias rizikos rūšis, įskaitant, bet neapsiribojant, rinkos, likvidumo, kredito ir kitas rizikas. Tvarumo rizikos poveikis investicijoms gali skirtis priklausomai nuo sektoriaus ar veiklos pobūdžio. Pavyzdžiui, investicijos į sektorius, pasižyminčius aukštu anglies dioksido išmetimo lygiu, gali būti labiau paveiktos klimato kaitos rizikų, tokių kaip sugriežtinta reguliacinė aplinka ar rinkos pokyčiai dėl perėjimo prie mažo anglies dioksido technologijų.

Šie veiksniai arba jų derinys gali turėti reikšmingą ir kartais nenusipėjamą poveikį investicijoms, įskaitant valdomo finansinio produkto vertės svyravimus. Tvarumo rizikos vertinimas yra glaudžiai susijęs su investicijų sektoriaus klasifikacija ir specifika, o jo įgyvendinimas yra grindžiamas vidinėmis Valdymo įmonės taisyklėmis.

Kiekvienam sektoriui reikalingi skirtingi duomenys ir analizės priemonės, kad būtų galima atlikti išsamų patikrinimą, įvertinti tvarumo rizikos reikšmingumą ir jos įtaką investicijų rezultatams.

Detalesnė informacija apie galimą tvarumo rizikos poveikį grąžai pateikiama kiekvieno fondo steigimo dokumentuose kartu su kita aktualia tvarumo informacija.

Šis pranešimas aktualus 2024 m. gruodžio 23 d.

UAB „Investicijų valdymas „Prosperus“ Direktorius



Gediminas Baltakis