

LUX IM – TYRUS GLOBAL CONVERTIBLE (“Comparto”)

Informativa sui comparti che promuovono caratteristiche ambientali e sociali secondo l’Articolo 8 del Regolamento EU relativo all’informativa sulla sostenibilità nel settore dei servizi finanziari (SFDR)

Section	Disclosure
Nessun obiettivo di investimento sostenibile	Il Comparto promuove caratteristiche ambientali e sociali, ma non ha nessun obiettivo di investimento sostenibile.
Caratteristiche ambientali o sociali del prodotto finanziario	<p>Il Comparto è una struttura “feeder” in conformità all’art. 77 della Legge sugli UCI. Esso investe almeno l’85% del proprio patrimonio netto in azioni di Tyrus Capital Investments – Tyrus Capital Global Convertible (il “Comparto Master”). Il Comparto Master è un comparto di Tyrus Capital Investments, una società di investimenti di tipo aperto con capitale variabile organizzata nella forma di un fondo ombrello, incorporata in Lussemburgo, e autorizzata come società di gestione collettiva del risparmio in valori mobiliari ai sensi della Parte I della Legge sugli UCI.</p> <p>Le informazioni riportate si riferiscono alle caratteristiche ambientali e sociali promosse dal Comparto Master. Il Comparto Master mira ad assicurare che tutte le sue obbligazioni convertibili “Vanilla” e le obbligazioni scambiabili siano allineate a caratteristiche ambientali o sociali, tramite l’applicazione di un modello proprietario più sotto descritto. Nonostante il Gestore agli Investimenti si affidi a fornitori esterni di dati ESG al fine di confrontare i punteggi ESG generati dal modello proprietario e/o quando non ci siano sufficienti dati per definire statisticamente un punteggio interno ESG, il Comparto Master non utilizza un indice di riferimento per valutare le proprie posizioni.</p>
Strategia di investimento	<p>Il Comparto è una struttura “feeder” in conformità all’art. 77 della Legge sugli UCI. Esso investe almeno l’85% del proprio patrimonio netto in azioni di Tyrus Capital Investments – Tyrus Capital Global Convertible (il “Comparto Master”). Il Comparto Master promuove caratteristiche sociali ed ambientali ed investe in emittenti che il Gestore agli Investimenti considera ben preparati per gestire le sfide materiali ambientali e sociali. Gli emittenti sono selezionati in base al sistema di riferimento ESG del Gestore agli Investimenti.</p> <p>Il Comparto Master promuove le seguenti caratteristiche ambientali e sociali:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Caratteristiche ambientali: <ul style="list-style-type: none"> o Emissioni di gas serra e anidride carbonica, calcolate in base ai ricavi; o Emissioni di anidride solforosa, calcolate in base ai ricavi; o Consumo di acqua, calcolato in base ai ricavi; o Contributo allo stress idrico; o Aree ambientali sensibili; o Consumo di energia, calcolato in base ai ricavi; o Percentuale di energia rinnovabile prodotta; o Percentuali di energia rinnovabile consumata; e o Rifiuti, calcolati in base ai ricavi. • Caratteristiche sociali: <ul style="list-style-type: none"> o Percentuale dei dipendenti di sesso femminile; o Divario retributivo di genere; o Percentuale di lavoratori sindacalizzati; o Rateo del tempo perso a causa di incidenti; e o Percentuale del turnover dei dipendenti. <p>Al fine di verificare l’idoneità degli investimenti target effettuati dal Comparto Master e, quindi, per misurare il conseguimento delle caratteristiche ambientali e sociali promosse, sono utilizzati i seguenti indicatori di sostenibilità:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Screening negativo: esclusione degli emittenti target coinvolti in condotte e/o attività controverse; • Screening positivo: selezione degli emittenti “best-in-class”. <p>Prima di ogni investimento e durante il periodo di detenzione dello stesso, viene applicato uno screening sulla base delle norme e degli standard internazionali, inclusi il Global Compact delle Nazioni Unite e le Linee Guida dell’OCSE destinate alle imprese multinazionali.</p>
Quota degli investimenti	<p>Il Comparto investe almeno l’85% del proprio patrimonio netto nel Comparto Master. Di conseguenza, la minima porzione del patrimonio netto del Comparto investita in titoli allineati alle caratteristiche sociali ed ambientali promosse è del 68%.</p> <div style="text-align: center; margin: 20px 0;"> <pre> graph LR A[Investimenti] --- B[#1 Allineati con caratteristiche A/S Min 68%] A --- C[#2 Altri] </pre> </div> <p>Il Comparto può investire sino al 15% del proprio patrimonio netto in liquidità accessoria e in derivati con finalità di copertura.</p> <p>Il Comparto Master può investire in strumenti finanziari derivati con finalità di copertura o per l’efficiente gestione del portafoglio. L’uso dei derivati non ha nessun effetto sui fattori ambientali e sociali promossi dal Comparto</p>

Section	Disclosure
	Master. Inoltre, il Comparto Master può investire in strumenti del mercato monetario e depositi (incluso denaro corrente ed equivalenti) per finalità di gestione della liquidità. Sono applicate misure minime di salvaguardia attraverso uno screening di conformità alle norme e standard internazionali, inclusi il Global Compact delle Nazioni Unite e le Linee Guida dell'OCSE destinate alle imprese multinazionali.
Monitoraggio delle caratteristiche ambientali o sociali	Al fine di verificare l'idoneità degli investimenti target effettuati dal Comparto Master e, quindi, per misurare il conseguimento delle caratteristiche ambientali e sociali promosse, sono utilizzati i seguenti elementi vincolanti: <ul style="list-style-type: none"> • Screening negativo (gravi controversie e specifiche attività); • Screening positivo (selezione ESG "best-in-class": la strategia rimuove emittenti dall'universo di investimento attraverso il sistema di punteggio ESG proprietario e, ferme le altre caratteristiche, seleziona quelli con un punteggio ESG migliore e/o mira a creare una maggiore esposizione verso gli stessi).
Metodologie relative alle caratteristiche ambientali o sociali	Al fine di raggiungere le caratteristiche ambientali e sociali promosse, l'ammissibilità degli investimenti target viene valutata sulla base delle procedure di screening negativo e screening positivo. Sono in atto controlli interni in relazione al processo decisionale di investimento del Comparto Master. Questi includono, ma non sono limitati a, i controlli pre-negoziazione e post-negoziazione per garantire che tutti gli elementi vincolanti applicabili siano osservati in ogni momento e la supervisione indipendente da parte delle funzioni di gestione del rischio, come richiesto.
Fonti e trattamento dei dati	Il Gestore agli Investimenti può utilizzare fornitori terzi di dati ESG al fine di confrontare i punteggi ESG generati dal modello proprietario e/o quando non ci siano sufficienti dati per definire statisticamente un punteggio interno ESG.
Limitazioni delle metodologie e dei dati	Considerata la metodologia di investimento sopra descritta e le fonti dei dati, le limitazioni al conseguimento delle caratteristiche ambientali e sociali promosse sono ritenute non sostanziali.
Dovuta diligenza	Per qualificarsi per l'investimento iniziale, gli investimenti target devono rispettare gli elementi vincolanti applicati dal Comparto Master. Tale conformità deve essere garantita dal Gestore agli Investimenti attraverso il meccanismo di conformità pre-negoziazione in atto.
Politiche di impegno	Questa sezione non è applicabile, in quanto il Comparto, per il raggiungimento delle caratteristiche ambientali o sociali promosse, non adotta una strategia di coinvolgimento ESG con le società emittenti.
Indice di riferimento designato	Nessun indice di riferimento è stato designato allo scopo di raggiungere le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal Comparto.