

Poročilo o upoštevanju trajnostnih vidikov pri podskladu Triglav Zeleni za mesec april 2023

Zavedamo se pomena boja proti klimatskim spremembam, zato ta produkt primarno zasleduje okoljski cilj, in sicer stremi k zasledovanju cilja Pariškega sporazuma glede omejitve dviga povprečne globalne temperature za 1,5 °C v primerjavi s predindustrijsko dobo.

Pri oblikovanju portfelja podsklada je tako veliko pozornosti namenjeno vidiku vpliva naložb na podnebne spremembe, zato imamo vzpostavljeno ciljno vrednost za ogljični odtis portfelja. Ciljna vrednost je vezana na ogljični odtis indeksa MSCI World Climate Paris Aligned, ki spada med indekse iz družine Indeksov EU za podnebne spremembe. Na dan 28.4.2023 je bil ogljični odtis portfelja podsklada Triglav Zeleni enak 352 ton CO₂ na milijon EUR sredstev, kar je bilo več od ogljičnega odtisa indeksa MSCI World Climate Paris (159,7 tone CO₂ na milijon EUR sredstev). Preseganje vrednosti v primerjavi s kriterijskimi indeksom je posledica spremembe vrednosti ogljičnega odtisa dveh podjetij pri katerih so se vrednosti močno povečale. Pri podjetju General Electric se je vrednost povečala iz 380 na 4.014 ton CO₂ na milijon EUR sredstev, pri podjetju Xylem se je vrednost povečala iz 297 na 2.829 ton CO₂ na milijon EUR sredstev. Spremembi sta posledica spremembe podatkov pri zunanjem ponudniku ESG podatkov dne 27.4.2023, ko je bila izvedena posodobitev podatkov za emisije 1, 2 in 3 za več kot tristo podjetij. Zaradi večje izpostavljenosti do zgoraj omenjenih podjetij (3,96% in 3,26% portfelja) je imela sprememba v portfelju večji vpliv kot v kriterijskem indeksu. Omenjeni podjetji sta bili iz portfelja odstranjeni in zamenjani z novimi naložbami tako, da je vrednost ogljičnega odtisa ponovno nižja od vrednosti kriterijskega indeksa.

Na področju zniževanja negativnega vpliva na podnebje izključujemo tudi podjetja, ki se ukvarjajo s fosilnimi gorivi oziroma so na seznamu Coal Exit List, ki ga pripravlja nevladna organizacija Urgewald. Na dan 28.4.2023 v portfelju ni bilo naložb s seznama Coal Exit List ali pa podjetij, ki se ukvarjajo s fosilnimi gorivi. Poleg tega se redno spremlja, ali imajo podjetja v portfelju izražene ambicije na področju zniževanja emisij toplogrednih plinov, kar je pomemben dejavnik pri ocenjevanju verjetnosti uspešnega zasledovanja in doseganja ciljev zastavljenih v okviru Pariškega sporazuma. Na dan 28.4.2023 so vsa podjetja v portfelju imela izražene ambicije na področju zniževanja emisij toplogrednih plinov.

Delež naložb, primernih po Taksonomiji EU, je presegal ciljnih 25 % in je znašal 36 %.

V portfelju ni bilo podjetja pri katerem bi bili ugotovljeni primeri resnih težav in incidentov v zvezi s človekovimi pravicami.

Načelo »ne škoduje bistveno« je bilo v celoti izpolnjeno. Nobeno podjetje ni bilo izpostavljeno tobačnim izdelkom, spornemu orožju, premogu in ni imelo spornih dejanj povezanih s trajnostjo, ki bi izkazovala visoko ali zelo visoko tveganje .

Pri pregledu vidika dobrega upravljanja so vsa podjetja dosegala zastavljene cilje.

Struktura portfelja podsklada Triglav Zeleni na dan 28.4.2023 deloma odraža usmeritve, opredeljene v Metodologiji za doseganje trajnostnih značilnosti naložb za podsklad Triglav Zeleni. Odstopanje je pri zavezi sklada glede ogjičnega odtisa portfelja, vendar je to, kot že omenjeno, posledica zunanjih dejavnikov – spremembe podatkov – na katero smo se kot upravljavci nemudoma odzvali. S tem je oblikovan naložben portfelj, ki je manj izpostavljen tveganjem iz naslova prihodnjih okoljskih in družbenih sprememb.