

Fidelity Institutional Liquidity Fund plc - The Euro Fund



A.Zusammenfassung

Der Fonds fördert ökologische oder soziale Merkmale, hat jedoch keine nachhaltige Anlage zum Ziel.

Der Fonds fördert ökologische und soziale Merkmale, indem er darauf abzielt, für sein Portfolio einen ESG-Score zu erreichen, der höher ist als der ESG-Score des Anlageuniversums des Fonds. Das Anlageuniversum umfasst zulässige Emittenten kurzfristiger Schuldtitel.

ESG-Scores werden anhand von ESG-Ratings ermittelt. ESG-Ratings berücksichtigen ökologische Merkmale wie Kohlenstoffintensität, Kohlenstoffemissionen, Energieeffizienz, Wasser- und Abfallmanagement und Biodiversität sowie soziale Merkmale wie Produktsicherheit, Lieferkette, Gesundheit und Sicherheit sowie Menschenrechte.

ESG-Scores einzelner Wertpapiere werden ermittelt, indem den ESG-Ratings von Fidelity und den von externen Agenturen bereitgestellten ESG-Ratings feste numerische Werte zugewiesen werden. Diese numerischen Werte werden aggregiert, um den durchschnittlichen ESG-Score des Portfolios und des Anlageuniversums zu bestimmen.

Der Fonds strebt einen ESG-Score für sein Portfolio an, der höher ist als der des Anlageuniversums des Fonds.

Darüber hinaus wird der Fonds die Ausschlüsse systematisch anwenden.

In Bezug auf Direktinvestitionen unterliegt der Fonds:

1. einer unternehmensweiten Ausschlussliste, die Streumunition und Antipersonenminen enthält, und
2. einer prinzipienbasierten Screening-Politik, die Folgendes umfasst:
 - (i) normenbasiertes Screening von Emittenten, die nach Auffassung des Anlageverwalters ihre Geschäfte nicht in Übereinstimmung mit internationalen Normen, einschließlich der im UNGC festgelegten, geführt haben; und
 - (ii) Negativ-Screening bestimmter Sektoren, Emittenten oder Praktiken auf der Grundlage spezifischer ESG-Kriterien, bei denen Umsatzschwellenwerte angewendet werden können.

Die Ausschlüsse und Screens (die „Ausschlüsse“) können von Zeit zu Zeit aktualisiert werden.

Das Portfolio-Compliance-Team von Fidelity überwacht den ESG-Score des Fondsportfolios vierteljährlich und verwendet dazu tägliche Datenpunkte aus dem internen Compliance-Überwachungssystem von Fidelity. Der Fonds zielt darauf ab, seine ESG-Score-Ziele zu erreichen, indem er sein Portfolio kontinuierlich anpasst.

Fidelity verwendet mehrere interne und externe Datenquellen, um ökologische oder soziale Merkmale zu bewerten. Die wichtigsten ESG-Komponenten, die bei der Bewertung ökologischer oder sozialer Merkmale durch den Fonds verwendet werden, sind ESG-Ratingdaten, Ausschlüsse, Aktivitäts-Screening- und Kontroversendaten, Daten zu den wichtigsten negativen Auswirkungen, Daten zur thematischen Ausrichtung und Daten zu nachhaltigen Investitionen.

Obwohl die ESG-Ratingmethode von Fidelity ein breites Spektrum an Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren abdeckt, wird sie verwendet, um die finanziell bedeutendsten ESG-Risiken und -Chancen zu identifizieren und ist daher möglicherweise nicht erschöpfend. Diese Beschränkungen haben jedoch keinen Einfluss darauf, wie die vom Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden, da sie mit dem Ziel gemildert werden, die Integrität und Angemessenheit der verwendeten Daten sicherzustellen.

Die Due Diligence der zugrunde liegenden Vermögenswerte wird unter Bezugnahme auf ESG-Ratings und -Engagement durchgeführt.

Das Engagement ist nicht Teil der ökologischen oder sozialen Anlagestrategie des Fonds.

Zum Erreichen der beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wurde kein ESG-Referenzwert festgelegt.

Datum der Erstveröffentlichung	Version	Datum der letzten Aktualisierung
01/01/2023	4	30/07/2024