

ARQUIA BANCA LIDERES DEL FUTURO FONDO DE INVERSION

Informe de gestión

Ejercicio 2022

**INFORMACIÓN PERIÓDICA DE LOS PRODUCTOS FINANCIEROS A QUE SE
REFIERE EL ARTÍCULO 8,
Apartados 1, 2 y 2bis, del REGLAMENTO (UE) 2019/2088 y el Artículo 6, párrafo primero, del
REGLAMENTO (UE) 2020/852**

ARQUIA BANCA LIDERES DEL FUTURO FI

Código LEI: 959800GD7KBA48126S71

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo medioambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Ese Reglamento no prevé una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

Características medioambientales o sociales

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

●● ☐ Sí●● ☒ No

☐ Realizó inversiones **sostenibles con un objetivo medioambiental**: ____%

☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE

☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE

☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social**: ____%

☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje de 18,35% de inversiones sostenibles

☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE

☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE

☒ con un objetivo social

☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

ARQUIA BANCA LIDERES DEL FUTURO FONDO DE INVERSION

Informe de gestión

Ejercicio 2022


¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

Este producto financiero no tiene un objetivo de inversión sostenible, pero promueve las siguientes características medioambientales y/o sociales:

- Transición energética: centrado en la electrificación de la sociedad y el abandono de los combustibles fósiles, incorporando subtemáticas como la movilidad eléctrica y autónoma, las tecnologías vinculadas a la generación de electricidad renovable, la explotación y distribución de esta energía, y la economía circular.
- Digitalización de la sociedad: centrado en el creciente peso de la tecnología en todos los aspectos de la vida, desde su vertiente de implementación en la empresa, a cómo se introduce en el día a día del consumidor.
- Vida saludable: centrado en las empresas que ayudan a vivir una vida más larga y de mayor calidad, partiendo de la biotecnología, pasando por la robótica aplicada a la medicina, y alcanzando a las empresas que nos ayudan a seguir una dieta más saludable.

A 31/12/2022, el 53,84% del patrimonio del producto financiero promovía estas características.

Los indicadores de sostenibilidad miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

A 31/12/2022, los indicadores de seguimiento de la promoción de características medioambientales y sociales fueron los siguientes:

- Indicador I: Cobertura datos ESG

El análisis del riesgo de sostenibilidad se basa en datos ESG de proveedores externos especializados. Para aquellos activos para los cuales no se dispone de ranking ESG, se aplica un proxy a partir de un modelo interno. A 31/12/2022, la cobertura de la cartera era del 95,29% del patrimonio, siendo el 4,71% restante cuentas de liquidez. El 87,64% del patrimonio es analizado mediante información ESG de proveedores externos y el 7,64%, mediante proxys.

- Indicador II: Criterios de exclusión

Este producto financiero aplica criterios excluyentes basados en el porcentaje de ingresos principales de las compañías dedicados a actividades como la producción y distribución de armas, el tabaco, el entretenimiento adulto (juego de azar y porno), las bebidas alcohólicas de alta graduación y las emisiones de gases de efecto invernadero.

A 31/12/2022, el producto cumplía con todos los criterios de exclusión establecidos en la política ESG del producto.

- Indicador III: Límites de controversias

Este producto financiero ha establecido un límite máximo sobre el nivel de controversias permitido. No se invertirá en compañías cuyo nivel de controversias, de acuerdo con la escala del proveedor externo ESG, sea severo.

A 31/12/2022, ninguna de las compañías en las que invertía el producto superaba el nivel de controversias máximo. El porcentaje de cobertura del nivel de controversias proporcionado por el proveedor externo ESG era del 75,40% sobre el patrimonio del producto.

ARQUIA BANCA LIDERES DEL FUTURO FONDO DE INVERSION

Informe de gestión

Ejercicio 2022

- **Indicador IV: Huella de carbono**

A 31/12/2022, la huella de carbono de la cartera era de 797 toneladas de CO₂e por millón de euros de invertidos.

o **¿... y en comparación con periodos anteriores?**

NA

o **¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?**

Este producto financiero mantendrá un porcentaje mínimo de inversiones sostenibles del 15% del patrimonio. Se pretende contribuir a objetivos sostenibles a través del impacto en los siguientes Objetivos de Desarrollo Sostenible (ODS) de las Naciones Unidas:

- Ambiental: Garantizar el acceso a una energía asequible, segura, sostenible y moderna (objetivo 7)
- Social: Garantizar una vida sana y promover el bienestar para todos en todas las edades (objetivo 3)

La contribución a estos ODS se calcula identificando el porcentaje de los ingresos de las compañías invertidas que están dedicados a la contribución a los ODS indicados.

A 31/12/2022, el 18,35% del patrimonio del producto eran inversiones sostenibles. La totalidad de las inversiones sostenibles de este producto eran inversiones en acciones.



Las principales incidencias adversas son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a la lucha contra la corrupción y el soborno.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

Para las inversiones sostenibles del producto financiero, de forma anual (en base a medias trimestrales) se realiza el seguimiento del principio de causar perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social mediante la medición de los indicadores de las Principales Incidencias Adversas en materia de sostenibilidad del Anexo I de las normas técnicas de regulación (RTS) del Reglamento Delegado (UE) 2022/1288.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Los resultados de la medición de los indicadores del anexo I de las RTS pueden ser consultados en el anexo a este documento.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

Se monitorizan las Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la Organización de Cooperación y Desarrollo Económicos (OCDE) para Empresas Multinacionales y la ausencia de procesos y mecanismos de cumplimiento para realizar un seguimiento del cumplimiento de los principios del Pacto

ARQUIA BANCA LIDERES DEL FUTURO FONDO DE INVERSION

Informe de gestión

Ejercicio 2022

Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales, a través de las RTS.

Este control es realizado no solo para las inversiones sostenibles, sino para toda la cartera de inversiones del producto. De este modo, a 31/12/2022 los resultados eran los siguientes:

Indicadores	Incidencia 31/12/2022	Cobertura
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la Organización de Cooperación y Desarrollo Económicos (OCDE) para Empresas Multinacionales	8,38%	94%
Ausencia de procesos y mecanismos de cumplimiento para realizar un seguimiento del cumplimiento de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	62,01%	88%

La taxonomía de la UE establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible realizada tampoco debe perjudicar significativamente ningún objetivo medioambiental o social.



¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

La medición de las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad se ha realizado a través del seguimiento de todos los indicadores del cuadro 1 y otros relevantes para el producto de los cuadros 2 y 3 del anexo I de las normas técnicas de regulación (RTS) del Reglamento Delegado (UE) 2022/1288.

Para esta primera fecha de referencia se ha empleado la cartera y los indicadores a fecha 31/12/2022 para la medición de las incidencias adversas del producto financiero.

La medición de estos indicadores se ha realizado a partir de información de proveedores externos. De forma complementaria, se ha realizado el seguimiento del porcentaje de cobertura de la cartera de cada uno de los indicadores medidos.

Se puede encontrar esta información en el documento anexo a este informe.

ARQUIA BANCA LIDERES DEL FUTURO FONDO DE INVERSION

Informe de gestión

Ejercicio 2022

**¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?**

A 31/12/2022 las quince principales posiciones del producto financiero son las siguientes:

La lista incluye las inversiones que constituyen la mayor parte de las inversiones del producto financiero durante el período de referencia, que es:

Inversiones más importantes	Sector	% de activos	País
1. Acc. Bristol Myers Squibb Co	Industria	3,10%	Estados Unidos
2. Liquidez EUR	Tesorería	2,90%	España
3. Acc. Darling Ingredients	Industria	2,80%	Estados Unidos
4. Acc. Asml Holding Nv	Industria	2,60%	Países Bajos
5. Acc. Enphase Energy Inc	Industria	2,60%	Estados Unidos
6. Acc. Vertex Pharmaceuticals	Industria	2,40%	Estados Unidos
7. Acc. Taiwan Semiconductor Manufacturing Co	Industria	2,40%	Taiwán
8. Acc. Microsoft Corp	Telecomunicaciones	2,40%	Estados Unidos
9. Acc. A10 Networks Inc	Telecomunicaciones	2,20%	Estados Unidos
10. Acc. Thermo Fisher Scientific Inc	Industria	2,20%	Estados Unidos
11. Acc. Sprouts Farmer Market Inc	Bienes y Servicios	2,20%	Estados Unidos
12. Acc. Solaria Energía y Medio Ambiente SA	Energía	2,00%	España
13. Acc. Meituan	Bienes y Servicios	1,90%	China
14. Acc. Tianneng Power International Ltd	Energía	1,90%	China
15. Acc. Regeneron Pharmaceuticals Inc	Industria	1,80%	Estados Unidos



La asignación de activos describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

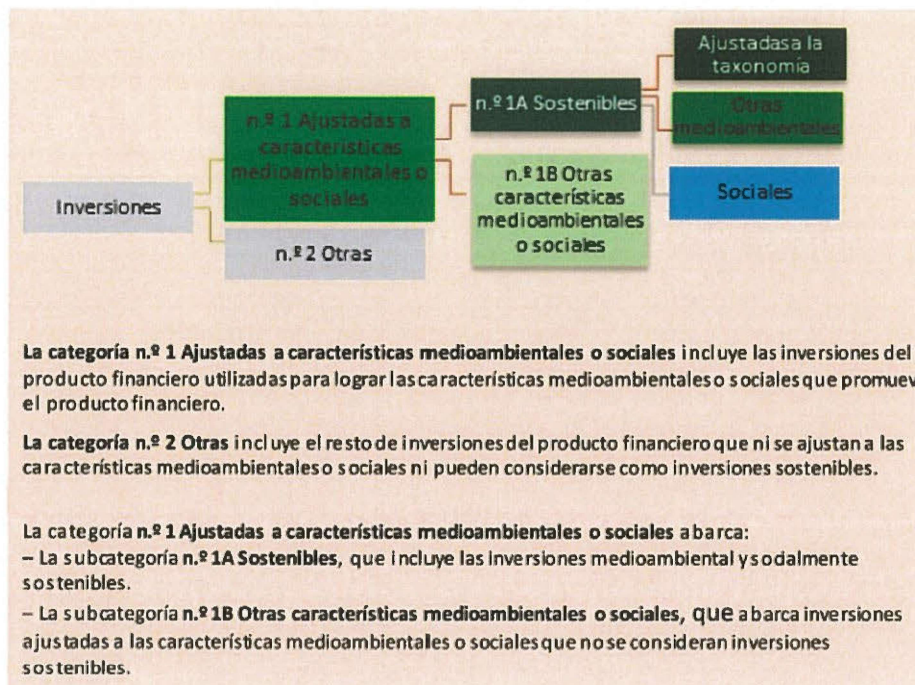
A 31/12/2022, el producto tenía un 53,84% del patrimonio dedicado a inversiones ajustadas a características medioambientales o sociales y un 18,35% del patrimonio a inversiones sostenibles medioambientales y sociales.

ARQUIA BANCA LIDERES DEL FUTURO FONDO DE INVERSION

Informe de gestión

Ejercicio 2022

● ¿Cuál ha sido la asignación de activos?



● ¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Los principales sectores en los que invertía el producto a 31/12/2022 son los siguientes:

Sector	% activos
Industria	58,1%
Bienes y Servicios	12,7%
Telecomunicaciones	11,8%
Energía	4,3%
Tecnología	3,8%
Utilities	3,1%
Bancos	3,0%
Construcción e inmobiliarias	2,0%
Transporte	1,2%



¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El producto financiero no se ha comprometido a un porcentaje mínimo de inversión en inversiones sostenibles de acuerdo con la taxonomía de la UE.

Para cumplir la taxonomía de la UE, los criterios para el gas fósil incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la energía nuclear, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos.

ARQUIA BANCA LIDERES DEL FUTURO FONDO DE INVERSION

Informe de gestión

Ejercicio 2022

Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:

El volumen de negocios, que refleja el porcentaje de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.

La inversión en activo fijo (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.

Los gastos de explotación (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Las actividades facilitadoras permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental.

Las actividades de transición son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

● ¿Invertió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE¹?

Sí:

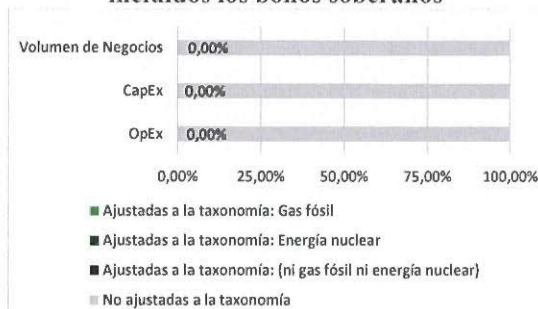
En el gas fósil

En la energía nuclear

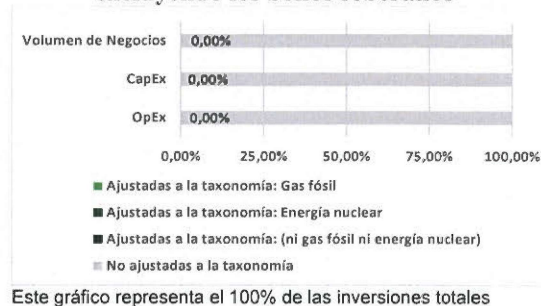
☒ No

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos*, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones incluidos los bonos soberanos*



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones excluyendo los bonos soberanos *



* A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas

● ¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transición y facilitadoras?

El producto financiero no se ha comprometido a una proporción mínima de inversión en actividades de transición y facilitadoras de acuerdo con la taxonomía de la UE.

● ¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los periodos de referencia anteriores?

NA

¹ Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

ARQUIA BANCA LIDERES DEL FUTURO FONDO DE INVERSION

Informe de gestión

Ejercicio 2022

 son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que no tienen en cuenta los criterios para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que no se ajustan a la taxonomía de la UE?

A 31/12/2022 el 8% del patrimonio del producto eran inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que no se ajusta a la taxonomía de la UE.



¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

A 31/12/2022, el 11% del patrimonio eran inversiones socialmente sostenibles.



¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

El apartado «Otras» a 31/12/2022 estaba compuesto por cuentas de liquidez y compañías que no cumplen con los criterios mínimos establecidos internamente para ser considerados dentro de la promoción de características medioambientales y/o sociales (por ejemplo, inversiones con un rating ESG inferior a BBB). No existen garantías medioambientales o sociales mínimas.



¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

Durante el año 2022 se han incorporado procedimientos de control y seguimiento del riesgo de sostenibilidad en el producto financiero con el objetivo de monitorizar el cumplimiento de los compromisos mínimos de promoción de características medioambientales y/o sociales y de inversión sostenible.

Para ello se elaboran informes de evaluación ESG de las inversiones donde se verifican los criterios de exclusión, de nivel de controversias y las inversiones sostenibles.



¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia asignado?

N/A

- **¿Cómo difiere el índice de referencia de un índice general de mercado?**

N/A

- **¿Cómo se ha comportado este producto financiero con respecto a los indicadores de sostenibilidad para determinar la conformidad del índice de referencia con las características medioambientales o sociales que promueve?**

N/A

- **¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia?**

N/A

- **¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice general de mercado?**

N/A

Los índices de referencia son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

ARQUIA BANCA LIDERES DEL FUTURO FONDO DE INVERSION

Informe de gestión

Ejercicio 2022

Cuadro 1

Declaración acerca de las principales incidencias adversas de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad.				
ARQUIGEST, S.A., SGIC (IEI 959800SRQ0N95SR96932)				
Resumen				
ARQUIA BANCA LIDERES DEL FUTURO, FI considera las principales incidencias adversas de sus decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad. La presente declaración es la declaración consolidada sobre las principales incidencias adversas o PIAs en los factores de sostenibilidad de ARQUIA BANCA LIDERES DEL FUTURO FI, la presente declaración relativa a las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad toma el 31 de diciembre 2022 como fecha de primera consideración.				
Descripción de las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad				
Los indicadores relacionados con el cambio climático y con el medio ambiente son la huella de carbono e inversiones en empresas sin iniciativas de reducción de las emisiones de carbono. Los indicadores sobre asuntos sociales y laborales, respeto de los derechos humanos y lucha contra la corrupción y el soborno son la brecha salarial entre hombres y mujeres y la ausencia de políticas de lucha contra la corrupción y el soborno.				
Indicadores aplicables a las inversiones en las empresas en las que se invierte				
Indicador de sostenibilidad en relación con incidencias adversas	Parámetro	Incidencia Diciembre 2022	Explicación	Medidas adoptadas, medidas previstas y objetivos establecidos para el próximo período de referencia
INDICADORES RELACIONADOS CON EL CAMBIO CLIMÁTICO Y OTROS INDICADORES RELACIONADOS CON EL MEDIO AMBIENTE				
Emisiones de gases de efecto invernadero (GEI)	1. Emisiones de GEI	100		
	Emisiones de GEI del ámbito 1 (tons CO2e)	103		
	Emisiones de GEI del ámbito 2 (tons CO2e)			
	Desde el 1 de enero 2023, Emisiones de GEI del ámbito 3	2.869		
	Total GEI (tons CO2e)	3.072		
	Huella de carbono (tons CO2e / EUR M invertidos)	797		
	3. Intensidad de GEI de las empresas en las que se invierte	1.164		
	Intensidad de GEI de las empresas en las que se invierte (tons CO2e / EUR M ingresos)			
	4. Exposición frente a empresas activas en el sector de los combustibles fósiles	2,53%		
Biodiversidad	Proportión de consumo de energía no renovable y de producción de energía no renovable de las empresas en las que se invierte procedente de fuentes de energía no renovable en comparación con fuentes de energía renovable (proporción respecto de la totalidad de las fuentes de energía)	38,01%		
	5. Proportión de producción y consumo de energía no renovable			
	Proportión de producción de energía no renovable y de producción de energía no renovable de las empresas en las que se invierte procedente de fuentes de energía no renovable en comparación con fuentes de energía renovable (proporción respecto de la totalidad de las fuentes de energía)	3,64%		
	Consumo de energía en GWh por millones EUR de ingresos de las empresas en las que se invierte, por sector de alto impacto climático B	0,01		
	Consumo de energía en GWh por millones EUR de ingresos de las empresas en las que se invierte, por sector de alto impacto climático C	0,29		
	Consumo de energía en GWh por millones EUR de ingresos de las empresas en las que se invierte, por sector de alto impacto climático D	0,07		
	Consumo de energía en GWh por millones EUR de ingresos de las empresas en las que se invierte, por sector de alto impacto climático E	0,00		
	Consumo de energía en GWh por millones EUR de ingresos de las empresas en las que se invierte, por sector de alto impacto climático G	0,00		
	Consumo de energía en GWh por millones EUR de ingresos de las empresas en las que se invierte, por sector de alto impacto climático H	0,01		
Agua	Consumo de energía en GWh por millones EUR de ingresos de las empresas en las que se invierte, por sector de alto impacto climático I	0,00		
	Proportión de inversiones en empresas con sedes u operaciones ubicadas en zonas sensibles en cuanto a la biodiversidad o cerca de ellas cuando las actividades de dichas empresas afectan negativamente a esas zonas	2,17%		
	7. Actividades que afectan negativamente a zonas sensibles en cuanto a la biodiversidad			
Residuos	8. Emisiones al agua	0,039		
	9. Ratio de residuos peligrosos y residuos radioactivos	0,55		
Toneladas de emisiones al agua generadas por las empresas en las que se invierte por millón EUR invertido (media ponderada)				
Toneladas de residuos peligrosos y residuos radioactivos generados por las empresas en las que se invierte por millón EUR invertido (media ponderada)				

Cobertura Datos
91%
91%
91%
2%
94%
94%
53%
6%
1%
43%
5%
0%
94%
1%
0%
94%
6%
53%

Ejercicio 2022

94%	86%
-----	-----