

## DECLARACIÓN ACERCA DE LAS PRINCIPALES INCIDENCIAS ADVERSAS DE LAS DECISIONES DE INVERSIÓN SOBRE LOS FACTORES DE SOSTENIBILIDAD.

SANTA LUCIA ASSET MANAGEMENT SGIIC, S.A.U. LEI: 959800YQ25SPNEF9LD86

### Resumen

SANTA LUCIA ASSET MANAGEMENT SGIIC, S.A.U. LEI: 959800YQ25SPNEF9LD86 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 en los factores de sostenibilidad.

La presente declaración relativa a las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad se realiza a fecha 31 de diciembre de 2022. No se incluyen datos del año 2021 debido a que la primera obligación legal sobre la publicación de la información se refiere al año 2022.

### DESCRIPCIÓN DE LAS PRINCIPALES INCIDENCIAS ADVERSAS SOBRE LOS ACTORES DE SOSTENIBILIDAD

#### INDICADORES APLICABLES A LAS EMPRESAS EN LAS QUE SE INVIERTE

Indicador de sostenibilidad en relación con incidencias adversas	Parámetro	Incidencia año 2022	Incidencia año 2021	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 invernadero (GEI)	1. Emisiones de GEI	Emisiones de GEI del ámbito 1	100.200 Toneladas CO <sub>2</sub> e	N/A	La cobertura sobre la cartera es del: 86,87%. Los principales contribuidores a este parámetro han sido: <ul style="list-style-type: none"> <li>FCC SERVICIOS MEDIO AMBIENTE HOLDING S.A.</li> <li>REPSOL INTL FINANCE</li> <li>ELECTRICITE DE FRANCE SA</li> <li>EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA</li> <li>VERALLIA PACKAGING SASU</li> </ul>	Análisis y seguimiento de los principales contribuidores a este parámetro
		Emisiones de GEI del ámbito 2	22.022 Toneladas CO <sub>2</sub> e	N/A	La cobertura sobre la cartera es del 87,12%. Los principales contribuidores a este parámetro han sido: <ul style="list-style-type: none"> <li>AIR LIQUIDE SA</li> <li>VERALLIA PACKAGING SASU</li> <li>FCC SERVICIOS MEDIO AMBIENTE HOLDING S.A.</li> <li>INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP</li> <li>SOL SPA</li> </ul>	Análisis y seguimiento de los principales contribuidores a este parámetro

		Emisiones de GEI del ámbito 3	972.052 ** Toneladas CO <sub>2</sub> e	N/A	La cobertura sobre la cartera es del 75,86%. Los principales contribuidores a este parámetro han sido: <ul style="list-style-type: none"> <li>• SIGNIFY NV</li> <li>• ALANTRA PARTNERS SA</li> <li>• REPSOL INTL FINANCE</li> <li>• AIRBUS SE</li> <li>• VOLVO TREASURY AB</li> </ul>	Análisis y seguimiento de los principales contribuidores a este parámetro
		Emisiones totales de GEI	1.141.455 Toneladas CO <sub>2</sub> e	N/A	La cobertura sobre la cartera es del 86,13%. Los principales contribuidores a este parámetro han sido: <ul style="list-style-type: none"> <li>• SIGNIFY NV</li> <li>• AIRBUS SE</li> <li>• REPSOL INTL FINANCE</li> <li>• VOLVO TREASURY AB</li> <li>• GALP ENERGIA SGPS SA</li> </ul>	Análisis y seguimiento de los principales contribuidores a este parámetro
2. Huella de carbono		Huella de carbono	539,69 Toneladas CO <sub>2</sub> e / Millón € invertido	N/A	La cobertura sobre la cartera es del 86,13%. Los principales contribuidores a este parámetro han sido: <ul style="list-style-type: none"> <li>• SIGNIFY NV</li> <li>• AIRBUS SE</li> <li>• REPSOL INTL FINANCE</li> <li>• VOLVO TREASURY AB</li> <li>• GALP ENERGIA SGPS SA</li> </ul>	Análisis y seguimiento de los principales contribuidores a este parámetro
3. Intensidad de GEI de las empresas en las que se invierte		Intensidad de GEI de las empresas en las que se invierte	1.144,28 Toneladas CO <sub>2</sub> e / Millón € ingresos	N/A	La cobertura sobre la cartera es del 87,16%. Los principales contribuidores a este parámetro han sido: <ul style="list-style-type: none"> <li>• AIRBUS SE</li> <li>• SIGNIFY NV</li> <li>• EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA</li> <li>• REPSOL INTL FINANCE</li> <li>• VOLVO TREASURY AB</li> </ul>	Análisis y seguimiento de los principales contribuidores a este parámetro
4. Exposición frente a empresas activas en el sector de los combustibles fósiles		Proporción de inversiones en empresas activas en el sector de los combustibles fósiles	8,38%	N/A	La cobertura sobre la cartera es del 82,41%. Los principales contribuidores a este parámetro han sido: <ul style="list-style-type: none"> <li>• GALP GAS NATURAL DISTRIBUTION, SA</li> <li>• ELECTRICITE DE FRANCE SA</li> <li>• GALP ENERGIA SGPS SA</li> <li>• CAPGEMINI SE</li> </ul>	Análisis y seguimiento de los principales contribuidores a este parámetro

					<ul style="list-style-type: none"> <li>• IBERDROLA SA</li> </ul>	
	5. Proporción de producción de energía no renovable	Proporción 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)	<p>Proporción de consumo:</p> <p>51,99%</p> <p>Proporción de producción:</p> <p>56,74%</p>	N/A	<p>La cobertura sobre la cartera es del 84,52% en Proporción consumo y del 93,94% en Proporción producción. Los principales contribuidores a este parámetro han sido:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• ELECTRICITE DE FRANCE SA</li> <li>• IBERDROLA INTL BV</li> <li>• IBERDROLA SA</li> <li>• EDP FINANCE BV</li> <li>• EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA</li> </ul>	Análisis y seguimiento de los principales contribuidores a este parámetro
	6. Intensidad de consumo de energía por sector de alto impacto climático	Consumo de energía en GWh por millones EUR de ingresos de las empresas en las que se invierte, por sector de alto impacto climático	13,90 GWh / Millón € ingresos	N/A	<p>La cobertura sobre la cartera es del 91,10%. Los principales contribuidores a este parámetro han sido:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• AIR LIQUIDE SA</li> <li>• IBERDROLA INTL BV</li> <li>• IBERDROLA SA</li> <li>• BEFESA S.A.</li> <li>• EDP FINANCE BV</li> </ul>	Análisis y seguimiento de los principales contribuidores a este parámetro
Biodiversidad	7. Actividades que afectan negativamente a zonas sensibles en cuanto a la biodiversidad	Proporción 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	1,63%	N/A	<p>La cobertura sobre la cartera es del 83,15%. Los principales contribuidores a este parámetro han sido:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• ELECTRICITE DE FRANCE SA</li> <li>• ENI SPA</li> </ul>	Análisis y seguimiento de los principales contribuidores a este parámetro
Agua	8. Emisiones al agua	Toneladas de emisiones al agua generadas por las empresas en las que se invierte por millón EUR invertido (media ponderada).	3,06 Toneladas / Millón € invertido x 10 <sup>-3</sup>	N/A	<p>La cobertura sobre la cartera es del 63,78%. Los principales contribuidores a este parámetro han sido:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• NAVIGATOR CO SA/THE</li> <li>• REPSOL INTL FINANCE</li> <li>• BAYER AG</li> <li>• SHELL PLC</li> <li>• BASF SE</li> </ul>	Análisis y seguimiento de los principales contribuidores a este parámetro
Residuos	9. Ratio de residuos peligrosos y residuos radioactivos	Toneladas de residuos peligrosos y residuos radioactivos generadas por las empresas en las que se invierte por millón EUR invertido (media ponderada)	6,34 Toneladas / Millón € invertido	N/A	<p>La cobertura sobre la cartera es del 73,19%. Los principales contribuidores a este parámetro han sido:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• BEFESA S.A.</li> </ul>	Análisis y seguimiento de los principales contribuidores a este parámetro

					<ul style="list-style-type: none"> <li>• FCC SERVICIOS MEDIO AMBIENTE HOLDING S.A.</li> <li>• FCC AQUALIA SA</li> <li>• TUBACEX SA</li> <li>• CIE AUTOMOTIVE SA</li> </ul>	
INDICADORES SOBRE ASUNTOS SOCIALES Y LABORALES, EL RESPETO DE LOS DERECHOS HUMANOS Y LA LUCHA CONTRA LA CORRUPCIÓN Y EL SOBORNO						
Asuntos sociales y laborales	10. 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	Proporción de inversiones en empresas que han estado relacionadas con infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	8,90%	N/A	<p>La cobertura sobre la cartera es del 83,03%. Los principales contribuidores a este parámetro han sido:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN</li> <li>• GOLDMAN SACHS GROUP INC</li> <li>• SWEDBANK AB</li> <li>• ELECTRICITE DE FRANCE SA</li> <li>• AIRBUS SE</li> </ul>	Análisis y seguimiento de los principales contribuidores a este parámetro
	11. 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	Proporción de inversiones en empresas sin políticas para realizar un seguimiento del cumplimiento de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas o de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales o sin mecanismos de gestión de reclamaciones o quejas para abordar las infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas o de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	0,25%	N/A	<p>La cobertura sobre la cartera es del 85,17%. Se deben a la inversión de fondos de terceros.</p>	Análisis y seguimiento de estos fondos
	12. Brecha salarial entre hombres y mujeres, sin ajustar	Brecha salarial promedio entre hombres y mujeres, sin ajustar, de las empresas en las que se invierte	14,22%	N/A	<p>La cobertura sobre la cartera es del 74,37%. Los principales contribuidores a este parámetro han sido:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• BANCO DE SABADELL SA</li> <li>• BANK OF AMERICA CORP</li> <li>• GOLDMAN SACHS GROUP INC</li> <li>• NATIONWIDE BLDG SOCIETY</li> <li>• UNICREDIT SPA</li> </ul>	Análisis y seguimiento de los principales contribuidores a este parámetro

	13. Diversidad de género de la junta directiva	Proporción entre el número de mujeres en la junta directiva y el número total de miembros (hombres y mujeres) de la junta directiva de las empresas en las que se invierte	35,43% % mujeres / total	N/A	La cobertura sobre la cartera es del 91,35%. Los principales contribuidores a este parámetro han sido: <ul style="list-style-type: none"> <li>• MONTANA AEROSPACE AG</li> <li>• ATENTO SA</li> <li>• IBERSOL SGPS SA</li> <li>• STABILUS S.A.</li> <li>• HERMES INTERNATIONAL</li> </ul>	Análisis y seguimiento de los principales contribuidores a este parámetro
	14. Exposición a armas controvertidas (minas antipersonas, municiones en racimo, armas químicas y armas biológicas)	Proporción de inversiones en empresas relacionadas con la fabricación o la venta de armas controvertidas	0,00% % x 10 <sup>-3</sup>	N/A	La cobertura sobre la cartera es del 82,55%.	Sin exposición

**INDICADORES APLICABLES A LAS INVERSIONES EN ENTIDADES SOBERANAS Y SUPRANACIONALES**

Indicador de sostenibilidad en relación con incidencias adversas	Parámetro	Incidencia año 2022	Incidencia año 2021	Explicación	Medidas adoptadas, medidas previstas y objetivos establecidos para el próximo período de referencia	
Medioambientales	15. Intensidad de GEI	Intensidad de GEI de los países receptores de la inversión	236,96 Toneladas CO <sub>2</sub> e / Millón € PIB	N/A	La cobertura sobre la cartera es del 79,93%. Los principales contribuidores a este parámetro han sido: <ul style="list-style-type: none"> <li>• DEUDA PUBLICA ITALIANA</li> <li>• DEUDA ESTADO ESPAÑA</li> <li>• AUTONOMOUS COMMUNITY OF MADRID</li> <li>• DEUDA PUBLICA ALEMANA</li> <li>• COMUNIDAD FORAL DE NAVARRA</li> </ul>	Análisis y seguimiento de los principales contribuidores a este parámetro
Sociales	16. Países receptores de la inversión sujetos a infracciones sociales	Número de países receptores de la inversión sujetos a infracciones sociales (número absoluto y número relativo, dividido entre todos los países receptores de la inversión) contempladas en los tratados y convenios internacionales, los principios de las Naciones Unidas y, cuando proceda, las leyes nacionales	Nº Absoluto: 5 Nº Relativo: 6,33%	N/A	La cobertura sobre la cartera es del 86,64%. Los países receptores de la inversión sujetos a infracciones sociales a los cuales se ve expuesto el fondo, se deben a la inversión de fondos de terceros.	Análisis y seguimiento de estos fondos

INDICADORES APLICABLES A LAS INVERSIONES EN ACTIVOS INMOBILIARIOS

Indicador de sostenibilidad en relación con incidencias adversas		Parámetro	Incidencia año 2022	Incidencia año 2021	Explicación	Medidas adoptadas, medidas previstas y objetivos establecidos para el próximo período de referencia
Combustibles fósiles	17. Exposición a combustibles fósiles a través de activos inmobiliarios	Proporción de inversiones en activos inmobiliarios relacionados con la extracción, el almacenamiento, el transporte o la fabricación de combustibles fósiles	N/A*	N/A	N/A	N/A
Eficiencia energética	18. Exposición a activos inmobiliarios energéticamente ineficientes	Porcentaje de inversiones en activos inmobiliarios energéticamente ineficientes	N/A*	N/A	N/A	N/A

Indicadores adicionales relacionados con el cambio climático y otros indicadores relacionados con el medio ambiente

Emisiones	19. Inversiones en empresas sin iniciativas de reducción de las emisiones de carbono	Porcentaje de inversiones en empresas sin iniciativas de reducción de las emisiones de carbono dirigidas a ajustarse al Acuerdo de París	84,11% **	N/A	La cobertura sobre la cartera es del 92,53%. Los principales contribuidores a este parámetro han sido: <ul style="list-style-type: none"> <li>• CAIXABANK SA</li> <li>• ETF LYXOR CORE STOXX EUROPE 600 DR</li> <li>• INTESA SANPAOLO SPA</li> <li>• FI MGI FUNDS PLC - MERCER PASSIVE GLOBAL EQUITY FUND</li> <li>• CAIXA GERAL DE DEPOSITOS</li> </ul>	Análisis y seguimiento de los principales contribuidores a este parámetro
-----------	--	--	-----------	-----	--	---

Indicadores adicionales sobre asuntos sociales y laborales, el respeto de los derechos humanos, y la lucha contra la corrupción y el soborno

Lucha contra la corrupción y el soborno	20. Ausencia de políticas de lucha contra la corrupción y el soborno	Proporción de inversiones en entidades sin políticas de lucha contra la corrupción y el soborno coherentes con la Convención de las Naciones Unidas contra la Corrupción	1,38% **	N/A	La cobertura sobre la cartera es del 91,68%. Los principales contribuidores a este parámetro han sido: <ul style="list-style-type: none"> <li>• BLACKSTONE PP EUR HOLD</li> <li>• GOLDEN BAR (SECURITISATION) S.R.L.</li> <li>• FI MGI FUNDS PLC - MERCER PASSIVE GLOBAL EQUITY FUND</li> <li>• AUTONORIA SPAIN 2021</li> <li>• ETF JPMORGAN USD EMERGING MARKETS</li> </ul>	Análisis y seguimiento de los principales contribuidores a este parámetro
---	--	--	----------	-----	--	---

					SOVEREIGN BOND UCITS ETF	
--	--	--	--	--	-----------------------------	--

\* Información no disponible, si bien este tipo de inversiones es inmaterial en el balance

\*\* Datos a febrero de 2023, por ser el primer momento en que se ha dispuesto de los mismos.

### Descripción de las políticas para determinar y priorizar las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad

Santalucía AM cuenta con una Política de Incidencias Adversas, la cual tiene como objetivo identificar y priorizar las incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad que conllevan las inversiones en determinados sectores, compañías o activos sobre el medioambiente y la sociedad. Así mismo sirve para determinar las diferentes actuaciones que se van a llevar a cabo para evitarlas o minimizarlas por parte de Santalucía AM, dando cumplimiento a las exigencias establecidas por la legislación vigente.

La Política fue aprobada por primera vez en el Consejo de Administración celebrado en septiembre de 2021 y será revisada, al menos, anualmente.

Santalucía AM ha decidido incorporar a su proceso de integración de riesgos ASG un análisis de las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad, siendo consciente de los efectos negativos que la inversión en determinados sectores, compañías o activos puede causar sobre el medioambiente y la sociedad.

En consecuencia, la integración de riesgos de sostenibilidad o ASG en los procesos de toma de decisiones de inversión es el proceso por el cual se analiza información sobre los factores ASG que afectan a las inversiones, se identifican y valoran posibles riesgos materiales y, por último, se toma una decisión respecto a si se invierte en un determinado activo. Se trata por tanto de un proceso que permite obtener mayor información sobre las inversiones y, de esta forma, una mejor gestión de los riesgos asociados.

Para ellos Santalucía AM ha seleccionado el proveedor de datos externo Clarity AI, unos de los referentes de mercado en el ámbito de sostenibilidad.

Clarity AI ha desarrollado una solución que permite a sus clientes informar y analizar los PIAs de sus inversiones, abordando todas las principales adversas obligatorias y opcionales, aplicables a empresas y soberanos.

Emplea una metodología personalizada para cada uno de los indicadores de PIAs, de acuerdo con las definiciones exactas del regulador.

### Políticas de implicación

La Política de Implicación a Largo Plazo de Santalucía AM tiene como objetivo establecer la estrategia adecuada y efectiva en relación a cómo integra su implicación como accionista o gestor de los accionistas en las políticas de inversión de las instituciones de inversión colectiva que gestiona, así como en la gestión de carteras de clientes.

La finalidad última es fomentar la implicación a largo plazo en las compañías en las que se invierte y, de este modo, mejorar el rendimiento financiero y no financiero de esas sociedades, también por lo que se refiere a factores medioambientales, sociales y de gestión.

En particular, la Política vigente persigue:

- Que el derecho de asistencia y voto inherente a los valores que integren las carteras de las instituciones gestionadas se ejerzan en interés de la institución gestionada y de los clientes, partícipes y/o accionistas, de conformidad con lo establecido en el artículo 46 de la Ley 35/2003 de Instituciones de Inversión Colectiva y la norma 3.4.v) de la Circular 6/2009 de control interno de las SGIC.
- que se ejerza el derecho de asistencia y voto en las juntas generales, de los valores integrados en las carteras gestionadas en interés de los clientes, salvo que, en los contratos de gestión, los delegantes se reserven el derecho de voto.
- que se realice un seguimiento de las compañías en las que se invierte;
- que se fomente el diálogo activo con las compañías en las que se invierte, en las que éste pueda afectar realmente a la gestión de las mismas.

### Referencias a normas internacionales

Durante 2022 se han llevado a cabo diversas iniciativas en materia de sostenibilidad:

1) Adhesión de Santalucía AM a los Principios de Inversión Responsable de Naciones Unidas (UN PRI) en calidad de gestor de inversiones. UN PRI es una red internacional de inversores respaldada por las Naciones Unidas que trabajan juntos para

implementar los seis Principios de Inversión Responsable.

2) A nivel grupo Santalucía, Compromiso con la Agenda 2030: Como empresa adherida al Pacto Mundial de Naciones Unidas, estamos comprometidos con los Objetivos de Desarrollo Sostenible (ODS) de la Agenda 2030. De los 17 Objetivos de Desarrollo Sostenible definidos por la ONU, hemos identificado aquellos ODS en los que tenemos impacto directo desde nuestra actividad para enfocar el esfuerzo en ellos como parte fundamental de nuestra hoja de ruta hacia la sostenibilidad.

3) Plan Corporativo de Sostenibilidad: El Plan Corporativo de Sostenibilidad del grupo Santalucía 2021-2024 define los objetivos y compromisos del Grupo con la gestión responsable del negocio y la creación de valor para las personas y el planeta. En concreto, persigue impactar en 10 indicadores clave asociados a los ejes ASG y se basa en tres pilares estratégicos fundamentales (Materialidad, Gobierno y Normativa y Transparencia) para impulsar el desarrollo sostenible de nuestro negocio, responder a las expectativas de los grupos de interés y mejorar nuestro impacto en el medio que nos rodea.

#### **Comparación histórica**

Esta es la primera declaración sobre las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad realizada, por lo que no existe la posibilidad de comparación histórica

**CO<sub>2</sub>e:** Equivalente de dióxido de carbono

**GWh:** Givatios hora

**Cobertura sobre la cartera:** Porcentaje de la cartera sobre el que existe medición de la incidencia adversa.