

MOOC
spainsif

Desde 2009 promoviendo la inversión sostenible

Elaboración de una Cartera de Inversión Sostenible

Con el patrocinio de:



PICTET
Asset Management

Módulo 3. Estructura

3.3. ¿Cómo seleccionar productos sostenibles para la cartera?

Jorge González Gómez
Director Análisis
Tressis SV

Con el patrocinio de:

1. Tipología de fondos (SFDR)
 - Productos que promocionan Características de Sostenibilidad (Artículo 8).
 - Productos con un Objetivo de Inversión Sostenible (Artículo 9).

Características

Criterios excluyentes

Protección de la vida humana

Promoción y protección de la dignidad humana

Reducción de la producción de armas

Protección del medio ambiente

Protección de la salud

Criterios valorativos

Lucha contra la pobreza, hambre y la desigualdad

Salud, bienestar y consumo responsable

Protección de los derechos humanos y laborales

Criterios no sostenibles:

- Objetivo de inversión del fondo
- Público objetivo
- Guías de gestión:
 - Universo de inversión
 - Índice de referencia
 - Restricciones/limites de inversión
 - Proceso de inversión, sesgos factoriales históricos
 - Proceso de selección de las inversiones
 - Gestión de riesgos
- Criterios cuantitativos: rentabilidad histórica, volatilidad, máximas caídas, desviaciones frente al índice....