

Declaração relativa aos principais impactos negativos das decisões de investimento sobre os fatores de sustentabilidade

Interveniente no mercado financeiro: Statusdesafio Capital - Sociedade Gestora de Organismos de Investimento Coletivo, SA (“Status Capital”)

Resumo

A Status Capital reconhece o papel a desempenhar na gestão responsável de ativos e considera os Principais Impactos Negativos da Sustentabilidade na sua gestão de Organismos de Investimento Coletivo.

No âmbito do processo de gestão e monitorização de desempenho de sustentabilidade, a Status Capital analisou a informação disponível e mais adequada à sua atividade e reporta na presente declaração sobre os Principais Impactos Negativos nos fatores de sustentabilidade os indicadores relativos ao período de 1 de janeiro a 31 de dezembro de 2023.

Descrição dos principais impactos negativos sobre os fatores de sustentabilidade

A Status Capital identifica os riscos do seu negócio em matéria de sustentabilidade e considera os principais impactos negativos de sustentabilidade. Estes riscos de sustentabilidade podem ser definidos como eventos ambientais, sociais e/ou de governo, que possam causar impactos negativos, reais ou potenciais nos fatores de sustentabilidade, como alterações climáticas e outras questões ambientais, respeito pelos direitos humanos, condições laborais e outras questões sociais, bem como na existência de normas e práticas de governação robustas e transparentes a nível corporativo. A negligência de tais riscos e os seus potenciais impactos negativos podem pôr em risco a rendibilidade dos ativos ao longo do tempo e conseqüentemente o valor do investimento.

Nos quadros abaixo estão descritos os principais impactos negativos associados à atividade de gestão de ativos da Status Capital (gestão de ativos imobiliários), tanto os indicadores obrigatórios, como um indicador não obrigatório, definidos no Regulamento SFDR.

Quadro 1

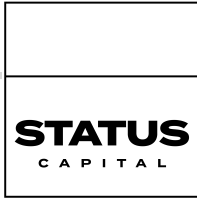
Descrição dos principais impactos negativos sobre os fatores de sustentabilidade

| Indicador negativo de sustentabilidade | | Métrica | Impacto 2023 | Impacto 2022 | Medidas adotadas, medidas planeadas e metas para o próximo período de referência |
|--|---|--|--------------|--------------|--|
| Indicadores aplicáveis aos investimentos em ativos imobiliários | | | | | |
| Combustíveis fósseis | 17. Exposição a combustíveis fósseis através de ativos imobiliários | Quota-parte dos investimentos em ativos imobiliários envolvidos na extração, armazenamento, transporte ou produção de combustíveis fósseis (%) | 0% (*) | 0% (*) | Por definir. |
| Eficiência energética | 18. Exposição a ativos imobiliários ineficientes do ponto de vista energético | Quota-parte dos investimentos em ativos imobiliários ineficientes do ponto de vista energético (%) | 93% (**) | 94% (**) | Por definir. |

Quadro 2

Indicadores adicionais sobre o clima e outros indicadores relacionados com o ambiente

| Indicador negativo de sustentabilidade | | Métrica | Impacto 2023 | Impacto 2022 | Medidas adotadas, medidas planeadas e metas para o próximo período de referência |
|--|-------------------------------|---|--------------|--------------|--|
| Indicadores aplicáveis aos investimentos em ativos imobiliários | | | | | |
| Biodiversidade | 22. Artificialização da terra | Porcentagem de superfície não vegetada (superfícies não vegetadas no solo, bem como em telhados, terraços e paredes) em comparação com a superfície total das parcelas de todos os ativos | 21% (***) | 12% (***) | Por definir. |



Quadro 3

Indicadores adicionais relacionados com as questões sociais e laborais, o respeito pelos direitos humanos e a luta contra a corrupção e o suborno

| Indicador negativo de sustentabilidade | Métrica | Impacto 2023 | Impacto 2022 | Medidas adotadas, medidas planeadas e metas para o próximo período de referência |
|--|---------|--------------|--------------|--|
| Indicadores aplicáveis aos investimentos em ativos imobiliários | | | | |
| Uma vez que o investimento em ativos imobiliários não tem associadas diretamente questões laborais e sociais, os indicadores do Quadro 3 não são aplicáveis à atividade da Status Capital. | | | | |

(*) Nenhum OIC sob gestão da Status Capital tem ativos expostos a combustíveis fósseis.

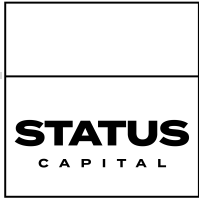
(**) Foram considerados como ativos energeticamente ineficiente os edifícios com certificado energético C ou inferior. Cálculo realizado com base nos m2 de cada ativo, face ao total dos ativos com certificado energético.

(***) Cálculo realizado com base nos m2 de cada Ativo Rústico, Misto ou Urbano dos Fundos sob gestão. Esta abordagem é simplificada, uma vez que foi assumido que toda a área urbana será artificializada, embora na prática tal não se verifique, e a percentagem de artificialização varie de ativo para ativo.

Descrição das políticas de identificação e definição de prioridades no que se refere aos principais impactos negativos sobre os fatores de sustentabilidade

A Status Capital está ciente dos riscos ambientais e sociais e o potencial impacto que estes terão para o seu negócio e para o futuro do planeta. A fim de identificar, reduzir e mitigar estes riscos, a Status Capital desenvolveu um modelo de risco que integra indicadores sociais, ambientais e de governo identificados como os mais relevantes para a atuação da empresa, estando num processo contínuo de recolha, análise e organização da informação necessária para o reporte do seu desempenho de sustentabilidade.

Os riscos de sustentabilidade serão considerados nos processos de investimento e tomada de decisão, complementando critérios financeiros tradicionais, nomeadamente nas análises de *due diligence*, que para além de legal, financeira e técnica, deverão, de futuro, também incluir análises relacionadas com temas ESG. Adicionalmente, em função da materialidade do impacto dos riscos, e da política de gestão de cada OIC, a Status Capital poderá estabelecer a exclusão de determinados investimentos, nomeadamente em Fundos de Artigo 8 ou 9.



Como resultado do modelo e da abordagem de gestão de risco, estão a ser analisadas as medidas de mitigação e contingência de riscos a implementar pela Sociedade Gestora. Estas medidas devem ter em consideração os pilares de atuação de sustentabilidade definidos pela Status Capital, por forma a contribuir para uma atividade que visa não só não prejudicar significativamente os objetivos ambientais de sustentabilidade como, quando aplicável, contribuir significativamente para um ou mais desses objetivos ambientais.

Ao nível dos ativos dos Fundos geridos pela Status Capital, e de acordo com as respetivas políticas de investimento, nas ações de desenvolvimento e benfeitorias a realizar poderão vir a ser implementadas medidas específicas para mitigação de riscos ESG. Os riscos de sustentabilidade serão monitorizados e acompanhados anualmente, integrados no modelo de risco da Sociedade Gestora.

Políticas de Envolvimento

A Status Capital não tem princípios de envolvimento formalizados numa Política de Envolvimento, no entanto, tem a ambição de promover matérias de sustentabilidade (ambientais, sociais e de governo) em nome dos OICs que gere e junto de eventuais empresas em que os Fundos sob gestão possam vir a ter participação. A adoção de melhores práticas ESG por parte de todas estas entidades permite a criação de valor a longo-prazo para o ambiente, sociedade e acionistas/participantes.

Referências às normas internacionais

A Status Capital ambiciona alinhar-se com as melhores práticas ESG, prevendo o alinhamento futuro com os Princípios para o Investimento Responsável das Nações Unidas para o Desenvolvimento Sustentável (PRI's). Estes princípios constituem um compromisso global da comunidade de investidores para o reconhecimento da importância do investimento responsável para o desenvolvimento sustentável.

Comparação em termos históricos

Os valores dos PINs mantiveram-se constantes face ao ano anterior, nomeadamente o indicador **17**. Exposição a combustíveis fósseis através de ativos imobiliários e **18**. Exposição a ativos imobiliários ineficientes do ponto de vista energético. O indicador **22**. Artificialização da terra verificou um aumento anual de 9%, devido ao aumento do número de OICs e de ativos sob gestão durante o ano de 2023, na sequência da angariação de um novo Fundo Imobiliário e da conversão de três novas SICs, correspondendo a imóveis urbanos, maioritariamente construídos ou para construção.