

„GAMCO International SICAV - GAMCO Merger Arbitrage“ SFDR 10 straipsnio paskelbimas tinklalapyje

(a) Suvestinė

„GAMCO International SICAV - GAMCO Merger Arbitrage“ (toliau – **Fondas**) atitinka Reglamento (ES) 2019/2088 dėl su tvarumu susijusios informacijos atskleidimo finansinių paslaugų sektoriuje (toliau – **SFDR**) 8 straipsnyje nustatytus reikalavimus. Fondas ne tik investuoja į įmones, kurios taiko gerąją valdymo praktiką, bet ir skatina šiuos aplinkos ir socialinius (toliau **E/S**) ypatumus:

1. Pasaulinis aplinkosaugos, socialinių reikalų ir valdymo (ang. Environmental, Social and Governance, ESG) stiprinimas

Fondas skatina pasaulinį ESG gerinimą, atidžiai atsižvelgdamas į atitinkamus aplinkosaugos, socialinius ir valdymo kriterijus, kuriuos nustato ESG reitingų teikėjas „Ethos Impact Inc.“ (toliau **Ethos**). Nustatant ESG reitingą atsižvelgiama į šiuos ESG aspektus: įmonių valdymas, prieiga prie pagrindinių paslaugų, kyšininkavimas ir korupcija, verslo etika, santykiai su bendruomene, duomenų privatumas ir saugumas, išmetami teršalai, nuotekos ir atliekos, anglies dioksido emisijos – nuosava veikla, anglies dioksido emisijos – produktai ir paslaugos, produktų ir paslaugų poveikis aplinkai ir mokslui, žmogaus teisės, žmogaus teisės – tiekimo grandinė, žmogiškasis kapitalas, žemės naudojimas ir biologinė įvairovė, žemės naudojimas ir biologinė įvairovė – tiekimo grandinė, profesinė sveikata ir sauga, produktų valdymas, atsparumas, išteklių naudojimas ir išteklių naudojimas tiekimo grandinėje.

2. Tvari įmonių lyderystė

Fondas skatina įmonių lyderystę tvaraus valdymo, produktų ir (arba) procesų srityje, taikydamas tiek įtraukties, tiek atskirties kriterijus, kad nustatytų atskiras įmones, kurios, palyginti su analogiškais pramonės įmonėmis, pasižymi apgalvotu požiūriu į tvarumą.

Fondo investavimo tikslas – siekti ilgalaikio jūsų investicijų augimo. Fondas taiko labai specializuotą investavimo metodą, kuriuo siekiama gauti pajamas daugiausia iš sėkmingai įgyvendintų siūlomų jungimų, perėmimų, viešųjų pirkimų pasiūlymų, išpirkimų skolintomis lėšomis ir kitų rūšių įmonių reorganizavimo.

Vykdydama šį procesą investavimo profesionalų komanda nustatys investavimo galimybes, kurios, jos nuomone, gali padėti pasiekti investavimo tikslą. Siekdamas nustatyti tam tikras investavimo galimybes, Fondas taiko kelių etapų investavimo strategiją, pagal kurią (i) investavimo metu taiko ESG atrankinės patikros perdangos procesą ir atmetimo politiką, kad nustatytų įmones, atitinkančias Fondo gaires dėl aplinkosaugos, socialinių ir valdymo charakteristikų (toliau – **ESG reikalavimus atitinkančios įmonės**), ir (ii) investuoja į diversifikuotą vertybinių popierių portfelį iš atrinktų ESG reikalavimus atitinkančių įmonių, kurios paskelbė apie turto jungimo ir įsigijimo sandorius ir pan.¹ Nuolat stebima, kaip laikomasi ESG atrankinės patikros perdangos proceso, atmetimo politikos ir gero valdymo kriterijų. Deramas patikrinimas atliekamas atliekant atitikties patikrinimus prieš sandorį ir stebėjimą po sandorio sudarymo. „Gabelli Funds LLC“ (toliau – **Investicijų valdytojas**) įgyvendino įvairias priemones, skirtas galimiems Fondo privalomų ESG kriterijų pažeidimams pašalinti.

Ne mažiau kaip 51 % Fondo portfelio sudarys investicijos, patenkančios į Fondo portfelio dalį, atitinkančią E/S ypatumus. Laikoma, kad investicija atitinka E/S ypatumus, jei ji atitinka ESG atrankos procesą ir atmetimo politiką, todėl bet kuri tokia investicija bus laikoma skatinančia

¹ Investavimo proceso etapų suskirstymas pateikiamas „GAMCO International SICAV - GAMCO Merger Arbitrage“ tinklalapio SFDR 10 straipsnio (d) „Investavimo strategija“ skirsnyje.

E/S ypatumus, kaip reikalaujama SFDR 8 straipsnyje. Todėl ne daugiau kaip 49 % Fondo portfelio sudarys investicijos, patenkančios į Fondo portfelio dalį „Kita“ (t. y., investicijos, neatitinkančios ESG atrankinės patikros proceso ir (arba) atmetimo politikos).

Nors Fondas naudoja sektoriuje pripažinta trečiųjų šalių reitingų agentūra („Ethos“), turinčia didelius pajėgumus, kaip pagrindiniu duomenų šaltiniu E/S ypatumų skatinimui vertinti, investuotojai turėtų atkreipti dėmesį, kad tam tikrais atvejais duomenų rinkiniai gali būti pagrįsti modeliuotais (o ne pateiktais) duomenimis, nes duomenų kokybė ir aprėptis priklauso nuo sektoriaus ir (arba) regiono, kuriame veikia bendrovė, ir dėl to gali kilti įvairių iššūkių.

Investuojant į šį finansinį produktą neatsižvelgiama į ES ekologiškai tvarios ekonominės veiklos kriterijus. Fondas neatsižvelgia į pagrindinį neigiamą poveikį (toliau – **PAIs**, *Principal Adverse Impacts*) tvarumo veiksniams, kaip apibrėžta SFDR. Nors Fondas skatina E/S ypatumus, jo tikslas nėra tvarus investavimas.

Fondas nenaudoja etaloninio lyginamojo indekso pirmiau minėtoms charakteristikoms pasiekti. Be to, nenumatoma, kad Investicijų valdytojas taikys įsitraukimo politiką kaip E/S strategijos dalį.