US EQUITY STEP IN 2028 AB

INFORMATIVA SULLA SOSTENIBILITÀ - Sintesi

Ai sensi dell'art. 24 del Regolamento UE 2022/1288

Questo prodotto finanziario promuove caratteristiche ambientali e sociali ma non ha come obiettivo un investimento sostenibile

Il Fondo promuove caratteristiche ambientali e sociali per almeno il 70% del proprio patrimonio. La restante parte del portafoglio potrà essere investita: in OICR ed ETF ex art. 6 Regolamento 2088/2019, strumenti finanziari privi di rating ESG MSCI, strumenti finanziari derivati, liquidità. Il fondo può investire fino ad un massimo del 60% in OICR ed ETF, che costituiscono gli investimenti indiretti nei soggetti che beneficiano degli investimenti.

Il Fondo promuove le seguenti caratteristiche ambientali e/o sociali il cui perseguimento è monitorato mediante specifici indicatori:

Caratteristica promossa	Indicatore
Rispetto di diritti umani e diritti dei lavoratori	Assenza di investimenti in emittenti societari che non rispettano tali diritti
Rispetto di convenzioni internazionali relative alle armi controverse	Assenza di investimenti in emittenti societari che non rispettano le convenzioni
Esclusione di business esposti a combustibili fossili altamente inquinanti	% di emittenti societari che (i) derivano più del 5% del loro fatturato dall'estrazione di carbone termico o di sabbie bituminose oppure (ii) derivano più del 20% del loro fatturato dalla generazione di energia da carbone termico

Per la quota parte di portafoglio investita in OICR ed ETF vengono inoltre monitorati i seguenti indicatori:

Indicatore
% di portafoglio investita in OICR ed ETF che prevedono politiche di gestione delle violazioni dei diritti umani da parte di emittenti societari
% di portafoglio investita in OICR ed ETF che prevedono politiche di esclusione di emittenti societari in caso di coinvolgimento nel business delle armi controverse

Il prodotto non ha un indice di riferimento sostenibile.

La promozione delle caratteristiche ambientali e sociali viene attuata mediante l'applicazione di una strategia d'investimento caratterizzata da elementi vincolanti riconducibili a specifici screening negativi e positivi da cui scaturiscono precisi limiti integrati nel sistema di Front Office e monitorati nel continuo dalla Funzione di Risk Management. Gli indicatori di sostenibilità usati per misurare la promozione delle caratteristiche ambientali e sociali sono monitorati lungo l'intero ciclo di vita del prodotto e rendicontati annualmente.

Gli elementi vincolanti della strategia di investimento sono compiutamente descritti nella versione completa della presente informativa.

Per la selezione degli investimenti, il monitoraggio dei principali effetti negativi e la misurazione degli indicatori di sostenibilità la SGR si avvale dei dati forniti dai provider MSCI nonché delle informazioni acquisite in sede di due diligence e/o dalla documentazione d'offerta per quanto concerne gli OICR ed ETF.

La qualità dei dati è garantita dal confronto costante con il provider sia per quanto concerne lo studio e la condivisione delle metodologie sottostanti la definizione degli stessi sia per approfondimenti in caso di dati apparentemente anomali.

I dati forniti dai provider MSCI sono in prevalenza stimati ma le misure adottate per garantire la qualità dei dati garantiscono che tale limitazione non influisca sul modo in cui sono soddisfatte le caratteristiche ambientali o sociali promosse. Eventuali disallineamenti rispetto ai dati stimati potranno verificarsi nel momento in cui gli emittenti societari renderanno pubblici i dati reali.

Modifiche del documento

Versione	Data	Descrizione modifiche
N.1	15/02/2023	Prima stesura della scheda di Informativa sulla sostenibilità ai sensi dell'art. 24 del Regolamento UE 2022/1288.