

Informativa sul prodotto pubblicata sul sito web ai sensi dell'art. 10, paragrafo 1 del Regolamento relativo all'informativa sulla sostenibilità nel settore dei servizi finanziari per l'art. 8 Comparti

SINTESI

Nome del prodotto: Lyxor MSCI New Energy ESG
Filtered (DR) UCITS ETF

Identificativo della persona giuridica:
9695008U0BHDZBWYFV02

Obiettivo di investimento sostenibile non previsto

Questo prodotto finanziario promuove caratteristiche ambientali o sociali, ma non pone come suo obiettivo l'investimento sostenibile.

Caratteristiche ambientali o sociali del prodotto finanziario

Il prodotto finanziario promuove caratteristiche ambientali e/o sociali attraverso la replica di un indice di riferimento che integra un rating ambientale, sociale e di governance ("ESG").

L'indice di riferimento è costruito utilizzando un approccio "Best in class", ovvero le società con i migliori rating ESG in ciascun settore (secondo il Global Industry Classification Standard [GICS]) vengono selezionate per costruire l'indice di riferimento.

L'approccio Best in class mira a favorire le società con le migliori performance all'interno di un universo, un settore o una classe. Con questo filtro "Best in class", il Comparto segue un approccio non finanziario impegnativo che consente di ridurre di almeno il 20% le dimensioni dell'Universo di investimento (in numero di emittenti).

Quota degli investimenti

Almeno il 90% dei titoli e degli strumenti dell'OICR è soggetto ad analisi ESG e pertanto è allineato alle caratteristiche ambientali o sociali promosse, in linea con gli elementi vincolanti della strategia di investimento. Inoltre, l'OIC si impegna a detenere almeno il 10% in investimenti sostenibili, come indicato nella tabella seguente.

Monitoraggio, metodologie, fonti di dati e loro limitazioni, dovuta diligenza e politiche di impegno

Tutti i dati non finanziari, sia esterni che interni, sono centralizzati dalla Linea di business dedicata agli investimenti responsabili, che ha il compito di controllare la qualità dei dati ricevuti e la loro diffusione. Questa verifica include un controllo qualità automatizzato e un controllo qualitativo effettuato da analisti ESG specializzati nel proprio settore. I punteggi ESG vengono aggiornati mensilmente nello strumento di rating proprietario di Amundi (modulo Stock Rating Integrator (SRI)).

Gli indici di sviluppo sostenibile utilizzati da Amundi si basano su metodologie proprietarie. Questi indici sono sempre disponibili nel sistema di gestione del portafoglio, consentendo ai gestori di valutare l'impatto delle loro decisioni di investimento.

Inoltre, tali indici sono integrati nel processo di controllo di Amundi, con responsabilità suddivise tra il primo livello di controllo effettuato dai team di investimento e il secondo livello di controllo effettuato dai team di rischio, che monitorano costantemente il rispetto delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal fondo.

Il rating ESG di Amundi utilizzato per determinare il punteggio ESG è un punteggio ESG quantitativo tradotto in sette rating, che vanno da A (i migliori punteggi dell'universo) a G (i peggiori). Nella scala di rating ESG di Amundi, i titoli appartenenti all'elenco delle esclusioni corrispondono a un rating G. Per gli emittenti corporate, la performance ESG è valutata globalmente e a livello dei criteri pertinenti rispetto alla performance media del suo proprio di attività, attraverso la combinazione delle tre dimensioni ESG.

La metodologia applicata nel rating ESG di Amundi utilizza 38 criteri, sia generali (comuni a tutte le aziende, qualunque sia il loro settore di attività) che settoriali specifici, ponderati per settore e presi in considerazione per il loro impatto su reputazione, efficienza operativa e regolamentazione con riferimento all'emittente. I rating ESG di Amundi possono essere espressi globalmente sulle tre dimensioni E, S e G, o singolarmente, su ciascuno dei fattori ambientali o sociali.

I punteggi ESG di Amundi sono costruiti utilizzando il sistema di analisi e la metodologia di valutazione ESG di Amundi. I dati provengono dalle seguenti fonti di dati ESG: Moody, ISS-Oekom, MSCI e Sustainalytics.

I limiti della nostra metodologia sono intrinsecamente legati all'utilizzo dei dati ESG. Il panorama dei dati ESG è in fase di normalizzazione, il che potrebbe influire sulla qualità dei dati; anche la copertura dei dati è un limite. La regolamentazione attuale e futura migliorerà la standardizzazione dei report e le dichiarazioni delle società su cui si basano i dati ESG.

Siamo consapevoli di tali limiti, che mitigiamo attraverso una combinazione.

Il punteggio ESG viene ricalcolato con frequenza mensile in base alla metodologia quantitativa di Amundi. Il risultato del calcolo è poi riesaminato dagli analisti ESG che eseguono una verifica qualitativa "a campione" sul settore di riferimento fondata su vari controlli.

Amundi adotta una politica di impegno nei confronti degli emittenti (quelli in cui già investiamo e quelli in cui potremmo potenzialmente investire) indipendentemente dal tipo di partecipazioni detenute (azioni e obbligazioni).