

Invesco S&P 500 ESG UCITS ETF EUR Hdg Acc



Questa comunicazione di marketing è per pura finalità esemplificativa ed è riservata all'utilizzo da parte dei Clienti Professionali in Italia. Non è destinata e non può essere distribuita o comunicata ai clienti al dettaglio. Il presente documento informativo contiene una descrizione sintetica del Invesco S&P 500 ESG UCITS ETF EUR Hdg Acc, un fondo negoziato in borsa (exchange traded fund o ETF), ed è esclusivamente finalizzato alla discussione. Si invita a consultare il Documento contenente le Informazioni chiave per gli Investitori (KIID), il prospetto e le informazioni importanti sul retro.

Obiettivo d'investimento

Invesco S&P 500 ESG UCITS ETF EUR Hdg Acc mira a replicare la performance, in termini di rendimento totale netto, del S&P 500 ESG EUR Daily Hedged Index, al netto delle commissioni. Il Fondo è gestito passivamente. L'investimento è costituito dall'acquisto di quote di un fondo e non dei titoli sottostanti.

Principali caratteristiche

- La struttura sintetica del fondo consente un'efficace replica dell'indice di riferimento.
- Struttura trasparente di commissioni e costi

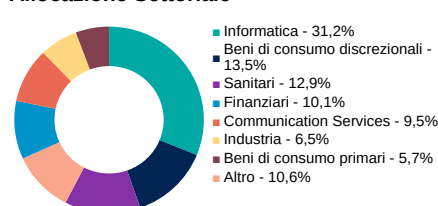
Considerazioni sui rischi

Per informazioni sui rischi complessivi, si prega di far riferimento alla documentazione d'offerta. Il valore degli investimenti e qualsiasi reddito da essi derivante possono oscillare. Ciò è dovuto in parte a fluttuazioni dei tassi di cambio. Gli investitori potrebbero non ottenere l'intero importo inizialmente investito. La capacità del Fondo di replicare la performance del benchmark dipende dalle controparti per garantire costantemente la performance del benchmark in linea con i contratti swap e, inoltre, potrebbe essere influenzata da qualsiasi spread tra i prezzi degli swap e i prezzi del benchmark. L'insolvenza di qualsiasi istituto che fornisca servizi quali la custodia di attività o che agisca in qualità di controparte di strumenti derivati o di altre tipologie di strumenti può esporre il Fondo a perdite finanziarie. Il Fondo intende investire in titoli di emittenti che gestiscono le proprie esposizioni ESG in modo migliore rispetto ai loro pari. Ciò potrebbe incidere sull'esposizione del Fondo a determinati emittenti e causare la sua rinuncia a talune opportunità d'investimento. Il Fondo può evidenziare risultati diversi rispetto ad altri fondi, come ad esempio performance inferiori rispetto ad altri fondi che non mirano a investire in titoli di emittenti sulla base dei loro rating ESG. Il Fondo potrebbe essere concentrato in una regione o in un settore specifico oppure essere esposto a un numero limitato di posizioni, con conseguenti fluttuazioni più ampie del suo valore rispetto a un fondo maggiormente diversificato. Il valore dei titoli azionari e dei titoli legati ad azioni può risentire di diversi fattori, come ad esempio le attività e i risultati dell'emittente e le condizioni economiche e di mercato sia generali che regionali. Ciò può determinare fluttuazioni del valore del Fondo. La copertura valutaria tra la valuta base del Fondo e la valuta della classe di azioni potrebbe non eliminare completamente il rischio di cambio tra queste due valute e potrebbe incidere negativamente sulla performance della classe di azioni. Il fondo potrebbe acquistare titoli che non sono contenuti nell'indice di riferimento e stipulerà contratti swap per scambiare la performance di tali titoli con la performance dell'indice di riferimento.

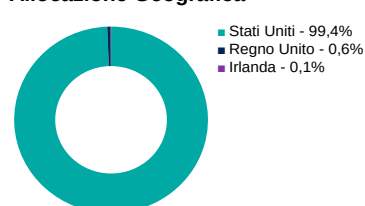
Informazioni sull'indice

L'indice S&P 500 ESG EUR Daily Hedged Index è un indice ponderato per la capitalizzazione di mercato, progettato per misurare la performance dei titoli che soddisfano i criteri ESG, mantenendo allo stesso tempo ponderazioni settoriali simili a quelle dell'S&P500.

Allocazione Settoriale



Allocazione Geografica



Le ponderazioni del portafoglio e le allocazioni possono cambiare.

Performance

La performance dell'ETF include il reinvestimento dei dividendi. La performance dell'ETF è basata sul Valore Attuale Netto al netto della commissione di gestione e altri costi, ma non tiene in considerazione eventuali commissioni o commissioni di custodia pagabili al momento dell'acquisto, detenzione o vendita dell'ETF. La performance dell'indice precedente al 28 gen 2019 è stata simulata ed è stata calcolata utilizzando le regole dell'indice. L'ETF non addebita commissioni di ingresso o uscita. Ogni periodo inizia alla fine del mese indicato. **I rendimenti passati non forniscono previsioni sui rendimenti futuri. Il valore su 3 anni è annualizzato.**

	29/02/12	28/02/13	28/02/14	28/02/15	29/02/16	28/02/17	28/02/18	28/02/19	29/02/20	28/02/21	31/12/18	31/12/20
ETF	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a
Indice*	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	18,95%	n/a	30,16%
Differenza*	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a

"n/a" indica una cronologia dei dati insufficiente. I rendimenti possono aumentare o diminuire in funzione della fluttuazione dei tassi di cambio.

Informazioni sulla negoziazione

Borsa valori	Deutsche Börse Xetra
Valuta di negoziazione	EUR
ISIN	IE000QF66PE6
Bloomberg	5ESE GR

Informazioni sull'indice

Indice	S&P 500 ESG EUR Daily Hedged Index
Valuta	USD

Informazioni sull'ETF

Metodologia di replica ³	Sintetica
Valuta di base	EUR
Commissione di gestione ⁴	0,09% p.a.
Trattamento dei dividendi	Accumulazione
Emittente	Invesco Markets plc
Gestore dell'investimento	Assenagon Asset Management S.A.
Domicilio	Irlanda
Data di lancio del comparto	9 marzo 2020
Data di lancio della classe	5 novembre 2021
SRRI ⁵	6

Available at etf.invesco.com

Prospetto, KIID (documento contenente le informazioni chiave per investitori), Titoli & NAV (Valore attuale netto)

- $(ETF + 1) / (Index + 1) - 1$
- Data: Bloomberg
- Per ulteriori informazioni, si veda la sezione "come L'ETF mira a ottenere l'obiettivo d'investimento prefissato", nella seconda pagina
- Include la commissione di gestione, i costi di custodia e di amministrazione, ma esclude i costi di transazione come i costi di swap. I costi possono aumentare o diminuire in funzione della fluttuazione delle valute e dei tassi di cambio. Si prega di consultare la documentazione legale d'offerta per ulteriori informazioni sui costi.
- Il profilo di rischio/rendimento classifica il fondo tramite un indicatore che rappresenta i livelli dal più basso (1) al più alto (7). Per ulteriori informazioni consultare il KIID

Contattaci

invest@invesco.com
etf.invesco.com

Cosa sono gli ETF?

Gli ETF sono fondi OICVM a capitale variabile. A differenza dei fondi a capitale variabile tradizionali, gli ETF possono essere comprati e venduti in borsa come le azioni ordinarie.

Come l'ETF mira a raggiungere l'obiettivo di investimento

L'ETF utilizza un metodo di replica sintetica; detiene un portafoglio diversificato di azioni che possono essere diverse da quelle dell'indice di riferimento. Le esclusioni ESG vengono applicate al portafoglio azionario detenuto dall'ETF, quali tabacco, armi controverse e il Low United Nation Global Compact; i filtri ESG aggiuntivi applicati nella metodologia dell'indice non vengono applicati al portafoglio di azioni detenute, tuttavia nel portafoglio azionario non è incluso alcun titolo specifico escluso dalla metodologia dell'indice. Per raggiungere l'obiettivo di investimento, l'ETF conclude contratti con una o più banche (le controparti), che accettano di pagare la differenza tra la performance del portafoglio e quella dell'indice, meno le eventuali commissioni. Tali contratti sono noti come swap. L'utilizzo degli swap garantisce una replica precisa dell'indice ma introduce anche il rischio di controparte: qualora una controparte non adempisse al pagamento della performance dell'indice come previsto dal contratto di swap, l'ETF potrebbe dover fare affidamento solo sulla performance del suo portafoglio azionario che potrebbe essere inferiore a quella dell'indice. L'esposizione di un ETF alla controparte di uno swap è limitata dalla normativa UCITS e dalle misure da noi imposte.

Chi è Invesco

Invesco si prefigge di aiutarti ad ottenere di più dalla vita cercando di offrire un'esperienza di investimento superiore. La nostra gamma prodotti passivi quotati exchange-traded products) è ideata per aiutare gli investitori ad ottenere il meglio dal proprio portafoglio, attraverso la scelta di prodotti a basso costo che replicano benchmark noti ed un range di prodotti che offrono vantaggi differenti. Vantiamo infatti competenze comprovate nel tempo in termini sia di innovazione che di investimento fattoriale, per questo molte delle esposizioni da noi offerte sono uniche e non disponibili presso altri operatori. Possediamo oggi la conoscenza del mercato necessaria per negoziare i nostri prodotti in maniera efficiente, ma anche la stabilità, le risorse e l'esperienza necessaria per raggiungere obiettivi di investimento a lungo termine.

Comprare o vendere i nostri ETF

Per comprare o vendere i nostri ETF si prega di consultare il proprio intermediario o consulente finanziario.

Glossario

Azioni A Azioni di società cinesi quotate su listini continentali e negoziate in valuta locale.

Azioni privilegiate Chiamate "preferred securities" negli Stati Uniti, si tratta di una categoria di azioni che attribuisce ai titolari un diritto di priorità rispetto agli azionisti ordinari in sede di distribuzione degli utili e di rimborso del capitale allo scioglimento della società, comportando, tuttavia, la limitazione dei diritti amministrativi (diritto di voto, diritto di impugnativa delle delibere assembleari, diritto di recesso, diritto di opzione).

Benchmark Indice di riferimento; utilizzato per confrontare le valutazioni dei titoli

Beta Unità che indica in che misura un fondo reagisce alle variazioni del suo benchmark. Un beta di valore 1 indica che il prezzo del fondo varia, in media, tanto quanto quello del benchmark; un beta superiore a 1 indica che il prezzo del fondo varia più del benchmark; un beta inferiore a 1 significa che il prezzo del fondo varia in misura minore.

Contratti forward su valute La negoziazione di valute fa parte delle transazioni valutarie degli istituti di credito e consiste generalmente nello scambio di due diverse valute.

Corporate governance La corporate governance è il quadro di riferimento legale e pratico per la gestione e la supervisione di società a beneficio delle parti interessate.

Derivati I derivati sono strumenti finanziari il cui prezzo è influenzato dalle variazioni di prezzo o dalle aspettative di prezzo di un altro strumento finanziario, definito "sottostante". I derivati possono essere utilizzati a scopo di copertura o a scopo speculativo. I derivati più diffusi sono certificati, opzioni, futures e swap.

Energy Master Limited Partnership (MLP) Entità quotate in borsa che non sono soggette all'imposta sulle società; la struttura è progettata per incoraggiare gli investimenti privati nelle risorse naturali.

ESG Temi ambientali, sociali e di governance, tre fattori chiave per misurare la sostenibilità e l'impatto sociale di un'azienda.

ETC Materie prime negoziate in borsa, strumenti di debito quotati e garantiti da una materia prima.

ETF Fondi negoziati in borsa. Un tipo di fondo negoziato sul mercato dei titoli come le azioni ordinarie. Gli ETF possono essere acquistati e venduti durante l'orario di contrattazione, come le azioni ordinarie, mentre altri tipi di fondi fanno prezzo una sola volta al giorno.

Factor Investing Una strategia d'investimento che seleziona i titoli in base a determinate caratteristiche e attributi in grado di comportare differenze nei rendimenti.

Fattori L'investimento fattoriale consiste nella selezione di titoli sulla base di determinati attributi quantitativi definiti "fattori", ad es. titoli che in passato hanno presentato una bassa volatilità.

Flottante negoziabile La parte delle azioni di una società che può essere quotata in borsa.

Hedged I contratti forward su valute sono utilizzati per la copertura di asset class, ovvero per proteggere queste ultime dalle fluttuazioni delle valute. L'obiettivo è ottenere una performance soddisfacente tanto quanto quella della valuta sottostante.

Investment grade (high quality) Titoli obbligazionari con rating creditizio elevato (minimo "BBB" attribuito da S&P).

Rapporto price-book value Il rapporto price-book value, o prezzo-valore contabile, è il rapporto tra il prezzo di mercato di un'azione e il suo valore contabile, ovvero la quota di capitale della società detenuta da ogni azionista. Più basso è il price-book value di una società, meno "costosa" saranno le sue azioni.

Società blue chip Le blue chip sono le azioni di grandi società ad alto rendimento. Le azioni blue chip sono ampiamente negoziate, generalmente con bassa volatilità.

Substance value La substance value è il valore netto combinato di tutti gli asset di una società.

Swap Gli swap sono derivati attraverso i quali i cash flow vengono scambiati allo scopo di gestire i rischi. Un esempio sono i tassi di interesse e gli swap di valuta.

UCITS Acronimo di "Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities". Nel contesto giuridico europeo, si tratta di fondi di investimento che investono in titoli e altri strumenti finanziari legalmente definiti (fondi in valori mobiliari).

Informazioni Importanti

Questa comunicazione di marketing è per pura finalità esemplificativa ed è riservata all'utilizzo da parte dei Clienti Professionali in Italia. Non è destinata e non può essere distribuita o comunicata ai clienti al dettaglio. I materiali di marketing possono essere distribuiti in altre giurisdizioni nel rispetto delle normative di collocamento privato e dei regolamenti locali.

Per maggiori informazioni sui nostri fondi e sui relativi rischi, si prega di far riferimento al Documento contenente le informazioni chiave per gli investitori (KIID) specifico per la classe di investimento, disponibile in italiano, alla relazione Annuale o Semestrale, al Prospetto e ai documenti costitutivi, disponibili sul sito www.invesco.eu. Una sintesi dei diritti degli investitori è disponibile al seguente link www.invesco-managementcompany.ie. La società di gestione può recedere dagli accordi di distribuzione. Il presente documento costituisce materiale di marketing e non deve essere interpretato come una raccomandazione a comprare o vendere in nessuna specifica classe d'attivo, nessun titolo o strategia. I requisiti normativi che necessitano l'imparzialità delle raccomandazioni d'investimento/di strategia d'investimento non sono quindi applicabili, né costituiscono un divieto alle contrattazioni prima della pubblicazione. Il presente documento non costituisce un consiglio d'investimento. Le persone interessate ad acquisire quote del fondo devono informarsi su (i) i requisiti legali nei paesi di nazionalità, residenza, residenza ordinaria o domicilio; (ii) eventuali controlli sui cambi valutarie e (iii) eventuali conseguenze fiscali rilevanti. Eventuali calcoli e grafici riportati nel presente documento sono forniti esclusivamente a titolo indicativo, rappresentano delle stime e non forniscono garanzie di rendimento o risultati futuri. La performance conseguita in passato non garantisce simili rendimenti futuri. Per ulteriori informazioni su commissioni e altri oneri, si prega di consultare il prospetto, il KIID e il supplemento di ciascun ETF. Le quote/azioni di UCITS ETF acquistate sul mercato secondario non possono solitamente essere rivendute direttamente all'UCITS ETF. L'investitore è tenuto ad acquistare e vendere quote/azioni sul mercato secondario tramite un intermediario (come un intermediario finanziario) e per farlo potrebbe dover sostenere dei costi. Inoltre, l'investitore potrebbe dover pagare più dell'attuale valore patrimoniale netto per l'acquisto di quote/azioni e ricevere meno dell'attuale valore patrimoniale netto al momento della vendita. Per conoscere tutti gli obiettivi e la politica di investimento, far riferimento al prospetto in vigore. La pubblicazione del supplemento al prospetto in Italia non sottintende un giudizio da parte della CONSOB sull'opportunità di investire in un prodotto. L'elenco dei prodotti quotati in Italia, i documenti dell'offerta e il supplemento di ciascun prodotto sono disponibili sui seguenti siti: (i) <https://etf.invesco.com> (dove sono inoltre disponibili la relazione annuale di bilancio certificata e i rendiconti semestrali non certificati); e (ii) sul sito Web della borsa valori italiana borsaitaliana.it.

S&P 500 ESG EUR Daily Hedged Index è un prodotto di S&P Dow Jones Indices LLC o delle sue affiliate ("SPDJ") ed è stato concesso in licenza d'uso a Invesco. Standard & Poor's® e S&P® sono marchi registrati di Standard & Poor's Financial Services LLC ("S&P"); Dow

Jones® è un marchio registrato di Dow Jones Trademark Holdings LLC ("Dow Jones"). Sono concessi in licenza d'uso a SPDJI e sublicenziati per determinati scopi a Invesco. Invesco S&P 500 ESG UCITS ETF EUR Hdg Acc non è sponsorizzato, approvato, venduto o promosso da SPDJI, Dow Jones, S&P e dalle rispettive affiliate e nessuna di tali parti rilascia alcuna dichiarazione in merito all'opportunità di investire in tale/i prodotto/i né ha alcuna responsabilità per errori, omissioni o interruzioni dell S&P 500 ESG EUR Daily Hedged Index.

I rating creditizi di ogni costituente del fondo si basano sui rating a lungo termine forniti da S&P, Moody's e Fitch. I rating sono convertiti nell'equivalente categoria di rating principale S&P e, laddove ne sia fornito più di uno, Invesco calcola il rating medio delle tre agenzie. Un titolo privo di rating non è necessariamente di bassa qualità. I rating e la qualità creditizia del portafoglio possono cambiare nel tempo. I rating esprimono un parere e non costituiscono dati di fatto o raccomandazioni di acquisto, detenzione o vendita di titoli. Non riguardano il valore di mercato dei titoli o la loro idoneità alle finalità d'investimento e non devono essere interpretati come una consulenza d'investimento. Benché i rating forniti da S&P Global Market Intelligence (insieme con le sue affiliate "S&P") possano essere usati come input per la creazione del punteggio composito, S&P non sponsorizza, approva o promuove tale punteggio. In nessun caso S&P potrà essere ritenuta responsabile per danni, siano essi diretti o indiretti, costi (inclusi quelli legali), spese, o qualsivoglia altra fonte di nocumento o perdita (ivi inclusi, a titolo meramente esemplificativo, perdite di guadagno o di profitto, perdita di opportunità, ovvero qualunque altro danno derivante da condotte colpose) in relazione a qualunque uso del punteggio composito o dei rating utilizzati come relativo input. Ove il punteggio composito sia stato creato utilizzando un rating fornito da S&P, tale rating è usato su licenza di S&P e S&P si riserva tutti i diritti in ordine a detto rating.

Il presente documento è comunicato da Investment Management Limited, Ground Floor, 2 Cumberland Place, Fenian Street, Dublin 2, Irlanda.

Supplemento ESG

Dati al 28 febbraio 2022

Impegno di Invesco sul fronte degli investimenti ESG

L'impegno a investire rispettando i criteri ESG è un elemento fondamentale dell'ambizione di Invesco a essere l'asset manager più cliente-centrico.

I fattori ambientali, sociali e di governance (ESG) sono una componente essenziale della nostra cultura aziendale e sappiamo che possono svolgere un ruolo importante nella strategia d'investimento dei nostri clienti.

Benché non tutti i nostri ETF seguano un indice con caratteristiche ESG specifiche, le informazioni in questa pagina vogliono aiutare i clienti nell'identificare i rischi e le opportunità associati agli investimenti.

I processi di screening delle imprese possono contribuire ad acquisire migliori dettagli sulle attività commerciali potenzialmente controverse cui un fondo o un indice può essere esposto.

Tutti i dati relativi a ESG, emissioni di carbonio e coinvolgimento delle imprese sono tratti da MSCI ESG Research. Allo scopo di valutare il profilo ESG, il fondo o l'indice deve comprendere almeno 10 titoli o costituenti e il 65% della ponderazione del fondo deve essere coperto da MSCI ESG Research. Per maggiori dettagli, si rimanda alla metodologia MSCI nel sito web www.msci.com

Articolo 6 SFDR

Ai fini del rispetto dei requisiti dell'Articolo 6 dell'SFDR, abbiamo riportato le informazioni sui rischi di sostenibilità nell'Addendum al Prospetto reperibile nel sito web etf.invesco.com.

Articolo 8 SFDR

Riteniamo che questo fondo promuova caratteristiche ambientali o sociali e rispetti i criteri di cui all'Articolo 8 dell'SFDR. Per maggiori informazioni consultare l'Addendum al Prospetto e la metodologia del fornitore dell'indice reperibili nel sito web etf.invesco.com.

Informazioni ESG importanti

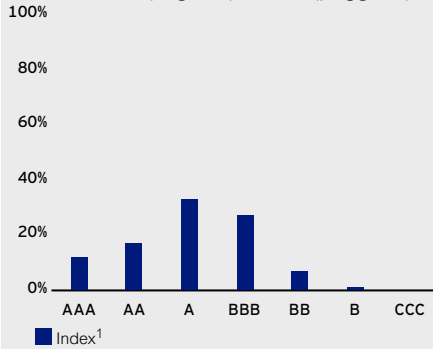
Le informazioni sopra riportate sono fornite a puro titolo illustrativo. Tali informazioni non intendono indicare né come né se i fattori ESG siano integrati in un fondo. Salvo altrimenti indicato nei documenti legali d'offerta (Documento contenente le informazioni chiave per gli investitori (KIID) specifico per la classe di azioni e il fondo, prospetto, relazioni annuali e semestrali), le informazioni ESG fornite nella presente pagina non modificano l'obiettivo o la politica d'investimento di un fondo e non ne limitano l'universo investibile. Per maggiori informazioni sulla strategia d'investimento di un fondo, si rimanda al relativo prospetto, gratuitamente disponibile nel nostro sito web etf.invesco.com e presso gli emittenti. Il rating può variare da un'agenzia di rating all'altra. Il rating può inoltre cambiare nel tempo e non costituisce una garanzia di performance future del fondo.

Profilo ESG	Index ¹
Rating fondo ESG (AAA-CCC)	AA
Punteggio qualità ESG (0-10)	8,2
Fattori ambientali Punteggio Pilastro	6,2
Sociali Punteggio Pilastro	5,2
Governance Punteggio Pilastro	4,9
Copertura % ESG	99,9

Impronta di carbonio	Index ¹
Emissioni Scope 1 (tonnellate di CO ₂ e)	39.767,7
Emissioni Scope 2 (tonnellate di CO ₂ e)	11.273,8
Intensità di carbonio totale (tonnellate di CO ₂ e/M USD)	105,2
Intensità di carbonio media ponderata (tonnellate di CO ₂ e/M USD)	105,9

Distribuzione dei rating ESG MSCI

Presenta la distribuzione dei rating ESG nel index da AAA (migliore) a CCC (peggiore).



Momentum trend ESG

La percentuale di aziende detenute dal fondo o dall'indice che hanno migliorato il rispettivo rating ESG (positivo), non presentano modifiche (stabile) o hanno peggiorato (negativo) rispetto alla valutazione precedente.

Trend	Index ¹
Positivo	30,4%
Stabile	66,3%
Negativo	3,2%
Nessun rating	-

Corporate Governance	Index ¹
Indipendenza del CdA	82,7%
Amministratori donne	33,3%

Screening ed esclusioni delle imprese	Index ¹
Violazioni secondo il Global Compact ONU	0,2%
Armi da fuoco per uso civile	-
Armi controverse	-
Armi convenzionali	0,2%
Armi nucleari	0,6%
Tabacco	-
Carbone termico	< 0.1%
Sabbie bituminose	-
Cannabis per uso ricreativo	< 0.1%

Rating ESG per settore ²	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC	Nessun rating
Servizi di Comunicazione	0,8%	1,6%	2,0%	10,5%	1,5%	0,3%	-	-
Beni di consumo voluttuari	0,1%	2,3%	3,6%	1,8%	0,5%	0,2%	-	-
Beni di consumo di prima necessità	0,2%	2,4%	1,5%	1,6%	-	-	-	-
Energia	< 0.1%	0,3%	0,9%	2,6%	0,1%	-	-	-
Prodotti finanziari	-	2,6%	4,4%	2,7%	0,2%	< 0.1%	-	0,1%
Assistenza sanitaria	0,2%	1,8%	3,7%	3,2%	3,1%	1,0%	-	-
Prodotti industriali	0,4%	0,5%	3,0%	2,0%	0,6%	0,1%	-	-
Information Technology	10,6%	3,5%	12,5%	1,6%	0,7%	-	-	-
Materiali	0,2%	0,7%	0,7%	0,9%	< 0.1%	-	-	-
Beni immobili	0,1%	0,8%	0,8%	0,5%	0,3%	-	< 0.1%	-
Servizi pubblici	-	0,9%	0,5%	< 0.1%	< 0.1%	-	-	-
Altro	-	-	-	-	-	-	-	-

Glossario

Rating fondi MSCI ESG: sono concepiti per misurare i rischi e le opportunità ESG delle partecipazioni sottostanti di un fondo, consentendo di classificare o selezionare fondi comuni ed ETF sulla base di una scala di rating da AAA a CCC. Questo rating mira a fornire trasparenza in termini di livello o fondo e misurare le caratteristiche ESG del portafoglio totale. È calcolato come mappatura diretta dei punteggi di qualità MSCI ESG in categorie di rating identificati con lettere. Gli ESG Leaders sono aziende con rating AAA o AA (best-in-class), mentre gli ESG Laggards sono aziende con rating ESG pari a B o CCC.

Punteggio di qualità MSCI ESG: è calcolato come media ponderata dei punteggi ESG della partecipazione sottostante. È fornito su una scala 0-10, dove 0 e 10 sono rispettivamente i punteggi più basso e più alto possibili. MSCI attribuisce i punteggi alle partecipazioni sottostanti in base alla loro esposizione a 20 rischi ESG rilevanti specifici per il settore e alla loro capacità di gestire tali rischi in rapporto ai peer. Questi punteggi ESG a livello di emittenti corrispondono a un rating ESG a livello di emittente. I punteggi si basano sui rating delle aziende aggiustati per il settore, elaborati da MSCI.

Copertura % ESG: è la percentuale del fondo e del benchmark per cui è disponibile MSCI ESG Research.

Emissione di CO₂ Scope 1: le emissioni dirette Scope 1 (tCO₂e) derivanti dalle attività di un'azienda. I dati sulle emissioni dirette rappresentano il valore finale rivisto e approvato da MSCI sulla base della metodologia MSCI, che seleziona il valore accurato dalle fonti disponibili.

Emissione di CO₂ Scope 2: le emissioni indirette energetiche Scope 2 (tCO₂e) derivanti dalle attività di un'azienda. I dati sulle emissioni indirette energetiche rappresentano il valore finale rivisto e approvato da MSCI sulla base della metodologia MSCI, che seleziona il valore accurato dalle fonti disponibili.

Intensità di carbonio totale: misura l'intensità di carbonio complessiva del fondo o dell'indice e l'efficienza carbonica associata alle relative partecipazioni, sulla base delle competenze in materia di carbonio e delle ricerche fornite da MSCI ESG Research. Utilizza i parametri di intensità di carbonio a livello di azienda (Scope 1 + Scope 2) per 1 milione di dollari USA di fatturato. Per i titoli di Stato, sono utilizzate solo le emissioni totali di carbonio del Paese per 1 milione di dollari USA di PIL.

Intensità di carbonio media ponderata: misura l'esposizione del fondo o dell'indice alle emissioni di carbonio e l'intensità associata alle relative partecipazioni, sulla base delle competenze in materia di carbonio e delle ricerche fornite da MSCI ESG Research. Utilizza i parametri di intensità di carbonio a livello di azienda (Scope 1 + Scope 2) per 1 milione di dollari USA di fatturato (per i titoli di Stato, sono utilizzate solo le emissioni totali di carbonio del Paese per 1 milione di dollari USA di PIL.), calcolata come media ponderata in base alla ponderazione del fondo o dell'indice.

Indipendenza del Consiglio di Amministrazione: percentuale media ponderata dei membri del CdA che rispettano i criteri MSCI di indipendenza.

Amministratori donne: percentuale media ponderata di donne facenti parte del CdA.

SFDR: il Regolamento relativo all'informativa sulla sostenibilità nel settore dei servizi finanziari (SFDR, conosciuto anche come Regolamento sull'informativa), che rientra nel Piano d'azione per la finanza sostenibile dell'UE, mira a promuovere la trasparenza per quanto riguarda la sostenibilità assicurando che i partecipanti al settore dei servizi finanziari forniscano ai clienti informazioni coerenti sulla sostenibilità dei prodotti e servizi forniti. Il supplemento del fondo e il sito web della società di gestione contengono ulteriori informazioni sulla conformità con il Regolamento SFDR.

Articolo 6: prevede l'obbligo, nel quadro dell'SFDR, di descrivere in che modo i rischi di sostenibilità sono integrati nelle decisioni di investimento, ovvero di fornire una spiegazione delle ragioni per cui i rischi di sostenibilità non sono ritenuti rilevanti.

Articolo 8 - Fondo: un fondo che, in conformità con i criteri indicati nell'Articolo 8 dell'SFDR, promuove, tra le altre caratteristiche, caratteristiche ambientali o sociali, o una combinazione di tali caratteristiche, a condizione che le imprese in cui il fondo investe rispettino prassi di buona governance.

Articolo 9 - Fondo: un fondo che, in conformità con i criteri previsti nell'Articolo 9 dell'SFDR, si prefigge l'obiettivo di effettuare investimenti sostenibili.

Determinate informazioni ©2021 MSCI ESG Research LLC. Riprodotto su autorizzazione; si prega di non redistribuire. Il presente report contiene alcune informazioni (le "Informazioni") tratte da MSCI ESG Research LLC, o sue affiliate o suoi fornitori di informazioni (le "Parti ESG"). Le informazioni sono fornite esclusivamente per uso interno, non possono essere riprodotte o ridistribuite in alcuna forma né essere utilizzate come base per un componente di indici oppure prodotti o strumenti finanziari.

Pur avendo ottenuto le informazioni da fonti considerate affidabili, nessuna Parte ESG assicura o garantisce l'originalità, l'accuratezza e/o la completezza dei dati contenuti nel presente documento e disconosce espressamente tutte le garanzie esplicite o implicite, incluse quelle di commerciabilità e idoneità a uno scopo particolare.

Nessuna informazione MSCI intende costituire una consulenza d'investimento o un invito a prendere (o non prendere) alcun genere di decisione d'investimento e non deve essere considerata come tale né intesa come un'indicazione o garanzia di future performance, analisi, stime o previsioni. Nessuna Parte ESG sarà responsabile di errori od omissioni in relazione a dati contenuti nel presente documento, o di danni diretti, indiretti, speciali, punitivi, consequenziali o di altro genere (inclusi mancati utili) anche laddove informata della possibilità degli stessi.

¹ L'indice è S&P 500 ESG NTR Index.

² La tabella Rating ESG per settore non include le posizioni liquide e pertanto potrebbe non totalizzare il 100%.

MSCI ESG Business Involvement Screening Research: fornisce ricerche sul coinvolgimento delle aziende nei vari prodotti e servizi, in modo da consentire agli investitori di selezionare le imprese in base a criteri specifici basati su principi etici, impatto, compliance o considerazioni sui rischi ESG.

Di seguito sono fornite definizioni sintetiche di ogni criterio di screening delle imprese:

Violazioni secondo il Global Compact ONU (UNGC): percentuale di aziende detenute dal fondo o dall'indice per le quali è stata accertata una violazione dei principi del Global Compact delle Nazioni Unite. I dati si basano sulle ricerche MSCI ESG Controversies e sullo screening delle norme globali MSCI ESG.

Armi controverse: percentuale di aziende detenute dal fondo o dall'indice che hanno legami accertati con armi controverse quali bombe a grappolo, mine antiuomo, armi biologiche e chimiche, proiettili a uranio impoverito, laser accecanti, armi incendiarie e/o intese a ferire con l'uso di frammenti non rilevabili.

Armi convenzionali: percentuale di aziende detenute dal fondo o dall'indice che hanno legami accertati con armi convenzionali, sistemi di armi, componenti, nonché sistemi di supporto e servizi.

Armi nucleari: percentuale di aziende detenute dal fondo o dall'indice che hanno legami accertati con la produzione di testate nucleari e/o interi missili nucleari, la realizzazione di componenti sviluppati o significativamente modificati per l'uso esclusivo in armi nucleari (testate e missili), la realizzazione o l'assemblaggio di piattaforme di lancio sviluppate o modificate in modo significativo per il lancio esclusivo di armi nucleari, la fornitura di servizi ausiliari associati ad armi nucleari.

Armi da fuoco per uso civile: percentuale di aziende detenute dal fondo o dall'indice che hanno legami accertati con armi da fuoco, munizioni per armi di piccolo calibro, incluse quelle automatiche e semiautomatiche destinate al mercato civile. Le ricerche escludono i prodotti venduti esclusivamente a eserciti, governi e forze di polizia.

Tabacco: percentuale di aziende detenute dal fondo o dall'indice che hanno legami accertati con prodotti a base di tabacco come sigari, kretek, tabacco senza combustione, tabacco da fiuto, tabacco per uso orale, tabacco dissolvibile e da masticare. Sono incluse anche le società che coltivano o lavorano foglie di tabacco grezzo.

Carbone termico: percentuale di aziende detenute dal fondo o dall'indice che hanno legami accertati con l'energia prodotta da carbone o traggono il fatturato dall'estrazione di carbone termico.

Sabbie bituminose: percentuale di aziende detenute dal fondo o dall'indice che hanno legami accertati con le sabbie bituminose, in particolare, proprietà di riserve e attività di produzione.

Cannabis per uso ricreativo: percentuale di aziende detenute dal fondo o dall'indice che hanno legami accertati con, o traggono fatturato da, cannabis per uso ricreativo.

Dati di contatto

Assistenza clienti

E-mail: invest@invesco.com
etf.invesco.com

Pubblicato da Invesco Investment Management Limited, Ground Floor, 2 Cumberland Place, Fenian Street, Dublin 2, Irlanda.

Autorizzata in Irlanda e regolamentata dalla Central Bank of Ireland.