

ROBECO

Documento di sintesi

Robeco Capital Growth Funds - Robeco QI US SDG & Climate Beta Equities

Gli investimenti sostenibili del Comparto mirano a ridurre l'impatto sulle emissioni di carbonio del portafoglio e quindi a contribuire agli obiettivi dell'Accordo di Parigi per mantenere l'aumento massimo della temperatura globale ben al di sotto dei 2°C.

Il Comparto ha un obiettivo di riduzione delle emissioni di carbonio e utilizza il MSCI USA EU PAB Overlay Index per monitorare il profilo di carbonio del Comparto.

Gli investimenti sostenibili contribuiscono in parte all'obiettivo ambientale della Mitigazione del clima ai sensi del regolamento sulla Tassonomia.

Strategia d'investimento

Robeco QI US SDG & Climate Beta Equities è un fondo a gestione attiva che investe in azioni di società degli Stati Uniti d'America. La selezione di questi titoli si basa su un modello quantitativo descritto nel paragrafo Strategia della politica d'investimento dell'Appendice I del presente Prospetto.

Beta indica l'approccio di gestione degli investimenti del Comparto che persegue esclusivamente l'obiettivo d'investimento sostenibile del Comparto. La strategia integra costantemente gli indicatori di sostenibilità nel processo di selezione delle azioni. Tra l'altro, il Comparto applica le esclusioni basate su norme e su attività, la politica di buona governance di Robeco, il Framework SDG di Robeco e tiene conto dei Principali effetti negativi nel processo di investimento.

Ulteriori informazioni specifiche sul prodotto sono disponibili sul nostro sito web e sui link forniti nella domanda finale di questa informativa.

Benchmark

Sì, il Comparto utilizza MSCI USA EU PAB Overlay Index come indice di riferimento per raggiungere l'obiettivo di riduzione dell'impatto sulle emissioni di carbonio del Comparto e quindi mantenere l'aumento massimo della temperatura globale ben al di sotto dei 2°C.

Quota degli investimenti

Il prodotto prevede di effettuare un minimo di 90 investimenti sostenibili, mentre la parte restante degli investimenti viene effettuata principalmente in liquidità e mezzi equivalenti.

Monitoraggio e due diligence

Robeco ha incorporato gli aspetti di sostenibilità delle strategie di investimento in adeguati processi e procedure di due diligence per la selezione e il monitoraggio degli investimenti, tenendo conto tra l'altro della propensione al rischio e delle politiche di gestione del rischio di sostenibilità di Robeco. I gestori di portafoglio e gli analisti sono i principali responsabili della due diligence degli investimenti da condurre sulle loro strategie con cadenza giornaliera. Sono supportati da un monitoraggio indipendente, effettuato dai dipartimenti Gestione del Rischio Finanziario e Limitazioni di investimento.

Metodologie e limiti delle fonti di dati

Il prodotto utilizza diverse fonti per la raccolta dei dati sulla sostenibilità. Robeco esamina la qualità dei dati di ciascun fornitore durante le valutazioni di due diligence, che comprende l'esame del modello di dati, l'esecuzione di controlli statistici e la valutazione della copertura. L'elaborazione dei dati avviene in forme diverse, si preferisce sempre automatizzare il più possibile l'acquisizione dei dati per evitare rischi operativi o interventi umani non necessari.

Robeco mantiene sul proprio sito web una documentazione metodologica completa dei propri framework analitici proprietari. Inoltre, per alcune caratteristiche sociali e ambientali, Robeco si affida a contenuti di provenienza esterna, per i quali mira a selezionare il miglior fornitore per ciascuna delle nostre caratteristiche target. La principale limitazione alla metodologia o alla fonte dei dati è la mancanza di divulgazione aziendale. Come molti altri operatori del mercato finanziario, abbiamo difficoltà a reperire informazioni adeguate sui principali indicatori negativi. Per ovviare a questo problema, Robeco è ricorsa all'utilizzo di più fornitori di dati, poiché ciascuno di essi ha i propri punti di forza e di debolezza.

Strategia di engagement

Le partecipazioni del fondo sono soggette al processo di selezione del programma di value engagement di Robeco, che consiste in un dialogo costruttivo tra gli investitori e le società partecipate per discutere le modalità di gestione dei rischi e delle opportunità ESG e l'impatto sugli stakeholder. Sebbene questo tipo di engagement non sia direttamente correlato all'obiettivo di investimento sostenibile del

fondo, è possibile che gli impatti negativi sulla sostenibilità vengano affrontati attraverso il programma di value engagement.