

**Informativa precontrattuale per i prodotti finanziari di cui all'articolo 8, paragrafi 1, 2 e 2 bis, del Regolamento (UE) 2019/2088 e all'articolo 6, primo comma, del Regolamento (UE) 2020/852.**

*Il presente documento viene fornito per facilitare la comprensione in lingua italiana dell'informativa sulla sostenibilità ai sensi del Regolamento (UE) 2019/2088 del Parlamento Europeo e del Consiglio del 27 novembre 2019 relativo all'informativa sulla sostenibilità nel settore dei servizi finanziari (c.d. SFDR); di conseguenza deve essere letto unitamente all'allegato sulla sostenibilità redatto da UBS Asset Management consultabile sul sito della Compagnia nella sezione dedicata "Consulta l'allegato sulla sostenibilità". In caso di differenze nelle versioni linguistiche tra quanto riportato nell'allegato messo a disposizione dalla Casa di Gestione e il presente documento, prevarrà il primo allegato pubblicato in lingua inglese.*

**Nome del prodotto:** UBS (Lux) Equity SICAV - Long Term Themes (USD)

**Codice LEI:** 549300ZFARXUQG507G05

## Caratteristiche ambientali e/o sociali

Per investimento sostenibile si intende un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, a condizione che l'investimento non danneggi in modo significativo alcun obiettivo ambientale o sociale e che le imprese che beneficiano degli investimenti seguano pratiche di buona governance.

La tassonomia dell'UE è un sistema di classificazione introdotto dal Regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale. Tale regolamento non stabilisce un elenco di attività economiche socialmente sostenibili. Gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale possono essere o meno allineati alla tassonomia.

**Questo prodotto finanziario ha un obiettivo di investimento sostenibile?**

☒ ☐ ☐ **Sì**

☐ ☒ ☐ **No**

☐ Effettuerà un minimo di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale: \_\_\_\_\_%

☐ in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la tassonomia UE

☐ in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la tassonomia dell'UE

☐ Effettuerà un minimo di investimenti sostenibili con un obiettivo sociale: \_\_\_\_%

☒ Promuove le caratteristiche ambientali/sociali (E/S) e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, avrà una percentuale minima del 40% di investimenti sostenibili

☐ con un obiettivo ambientale in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la tassonomia UE

☒ con un obiettivo ambientale in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la tassonomia UE

☒ con un obiettivo sociale

☐ Promuove le caratteristiche di E/S, ma non farà investimenti sostenibili

### Quali caratteristiche ambientali e/o sociali sono promosse da questo prodotto finanziario?

Il prodotto finanziario promuove le seguenti caratteristiche:

- 1) Un profilo di sostenibilità superiore a quello del benchmark di riferimento o un punteggio di consenso UBS ESG compreso tra 7 e 10 (che indica un profilo di sostenibilità forte).
- 2) Un'intensità media ponderata di carbonio (WACI) inferiore al benchmark di riferimento o un profilo di carbonio assoluto basso.

Il benchmark è un indice di mercato ampio che non valuta o include i costituenti in base alle caratteristiche ambientali e/o sociali e pertanto non intende essere coerente con le caratteristiche promosse dal prodotto finanziario. Non è stato designato alcun benchmark di riferimento ESG al fine di raggiungere le caratteristiche promosse dal prodotto finanziario.

**Quali indicatori di sostenibilità vengono utilizzati per misurare il raggiungimento di ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse da questo prodotto finanziario?**

Le caratteristiche di cui sopra sono misurate rispettivamente con i seguenti indicatori:

CNP UniCredit Vita S.p.A. - Società soggetta a direzione e coordinamento di CNP Assurances S.A. - Sede Legale: Via Cornalia, 30 - 20124 Milano (ITALIA) - Impresa autorizzata all'esercizio delle assicurazioni con provv. IVASS n° 580 del 26/5/97 pubblicato sulla G.U. n° 126 del 2/6/97 - Capitale sociale Euro 381.698.528,64 i.v. - Registro delle Imprese di Milano e C. Fiscale 07084500011 P. IVA 13362170154 - Iscritta all'Albo delle imprese di assicurazione e riassicurazione al n. 1.00129 - Tel. +39 02 9118.4212 - Fax +39 02 9118.4061 - info\_cnpvita@pec.it - www.cnpvita.it.

Per la caratteristica 1):

Il punteggio di consenso UBS ESG viene utilizzato per identificare gli emittenti/società dell'universo d'investimento con forti caratteristiche di performance ambientale e sociale, o un forte profilo di sostenibilità. Questo UBS ESG consensus score è una media ponderata normalizzata di dati ESG provenienti da fornitori interni ed esterni riconosciuti. Piuttosto che affidarsi al punteggio ESG di un singolo fornitore, l'approccio del consensus score aumenta la convinzione della validità del profilo di sostenibilità.

L'UBS ESG consensus score valuta i fattori di sostenibilità, come la performance degli emittenti/società interessati con riferimento agli aspetti ambientali, sociali e di governance (ESG). Questi aspetti ESG si riferiscono alle principali aree in cui operano gli emittenti/società e alla loro efficacia nella gestione dei rischi ESG. I fattori ambientali e sociali possono includere (tra gli altri) i seguenti aspetti: impronta ambientale ed efficienza operativa, gestione del rischio ambientale, cambiamenti climatici, utilizzo delle risorse naturali, inquinamento e gestione dei rifiuti, standard occupazionali e monitoraggio della catena di fornitura, capitale umano, diversità all'interno del consiglio di amministrazione, salute e sicurezza sul lavoro, sicurezza dei prodotti, nonché linee guida antifrode e anticorruzione.

I singoli investimenti del comparto hanno un punteggio di consenso UBS ESG (su una scala da 0 a 10, dove 10 rappresenta il miglior profilo di sostenibilità).

Per la caratteristica 2):

Intensità media ponderata di carbonio (WACI) degli ambiti 1 e 2:

- L'ambito 1 si riferisce alle emissioni dirette di carbonio e comprende pertanto tutte le emissioni dirette di gas a effetto serra provenienti da fonti di proprietà o controllate dall'entità o dall'emittente in questione.
- L'ambito 2 si riferisce alle emissioni indirette di carbonio e comprende quindi le emissioni di gas a effetto serra derivanti dalla generazione di elettricità, energia termica e/o vapore consumati dall'entità o dall'emittente in questione.

Il profilo a basso contenuto di carbonio assoluto è definito come inferiore a 100 tonnellate di emissioni di CO<sub>2</sub> per milione di dollari di fatturato.

### Quali sono gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende parzialmente realizzare e come l'investimento sostenibile contribuisce a tali obiettivi?

L'obiettivo degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende parzialmente realizzare è quello di contribuire alle caratteristiche ambientali e/o sociali promosse dal prodotto finanziario.

### In che modo gli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende parzialmente realizzare non causano danni significativi agli obiettivi di investimento sostenibile ambientale o sociale?

Il Gestore del portafoglio applica le esclusioni all'universo d'investimento del prodotto finanziario. Il link alla Politica di esclusione della sostenibilità si trova nel corpo principale del Prospetto di vendita.

Le esclusioni includono l'estrazione di carbone termico e la produzione di energia da carbone termico e sabbie bituminose; il gestore del portafoglio seleziona gli investimenti in base a un'intensità di carbonio assoluta o relativa inferiore all'ambito 1+2. USB Asset Management non investe in società coinvolte in armi controverse, come munizioni a grappolo, mine antiuomo, armi chimiche e biologiche, né in società che violano il Trattato di non proliferazione delle armi nucleari.

Gli investimenti sono vagliati positivamente in base alle caratteristiche ambientali e/o sociali promosse dal prodotto finanziario.

### Come sono stati presi in considerazione gli indicatori degli impatti negativi sui fattori di sostenibilità?

Il Gestore di Portafoglio utilizza un cruscotto proprietario per il rischio ESG, che consente agli analisti azionari e del credito di identificare rapidamente le società con rischi ESG significativi attraverso il "Segnale di rischio ESG di UBS". Questo segnale, chiaro e concreto, serve come punto di partenza per un'analisi più approfondita delle fonti sottostanti di questi rischi e dei collegamenti con i loro casi d'investimento.

I principali impatti negativi sono gli impatti negativi più significativi delle decisioni di investimento sui fattori di sostenibilità relativi a questioni ambientali, sociali e relative ai dipendenti, al rispetto dei diritti umani, alla lotta alla corruzione e all'anticorruzione.

*In che modo gli investimenti sostenibili sono allineati con le Linee guida dell'OCSE per le imprese multinazionali e con i Principi guida delle Nazioni Unite su imprese e diritti umani? Dettagli:*

Le società che violano i principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC) e che non dimostrano un'azione correttiva credibile saranno escluse dall'universo di investimento.

*La Tassonomia dell'UE stabilisce il principio "non arrechino un danno significativo", in base al quale gli investimenti allineati alla Tassonomia non dovrebbero danneggiare in modo significativo gli obiettivi della Tassonomia dell'UE, ed è accompagnata da criteri specifici per l'UE.*

Il principio "non arrechino un danno significativo" si applica solo agli investimenti sottostanti il prodotto finanziario che tengono conto dei criteri UE per le attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale. Gli investimenti sottostanti la parte restante di questo prodotto finanziario non tengono conto dei criteri UE per le attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale.

*Anche gli altri investimenti sostenibili non devono arrecare danno significativo agli obiettivi ambientali o sociali.*



### Questo prodotto finanziario considera i principali impatti negativi sui fattori di sostenibilità?



Sì, il Gestore del portafoglio applica delle esclusioni all'universo d'investimento del prodotto finanziario. Il link alla Politica di esclusione della sostenibilità si trova nel corpo principale del Prospetto di vendita.

Le esclusioni includono l'estrazione di carbone termico e la produzione di energia basata sul carbone termico e sulle sabbie bituminose; il gestore del portafoglio seleziona gli investimenti in base a un'intensità di carbonio assoluta o relativa inferiore all'ambito 1+2. UBS Asset Management non investe in società coinvolte in armi controverse, come munizioni a grappolo, mine antiuomo, armi chimiche e biologiche, né in società che violano il Trattato di non proliferazione delle armi nucleari.

Il Gestore di Portafoglio utilizza un cruscotto proprietario per il rischio ESG, che consente agli analisti azionari e del credito di identificare rapidamente le società con rischi ESG significativi attraverso il "Segnale di rischio ESG di UBS". Questo segnale, chiaro e concreto, serve come punto di partenza per un'analisi più approfondita delle fonti sottostanti di questi rischi e dei collegamenti con i loro casi d'investimento.

Le società che violano i principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC) e che non dimostrano un'azione correttiva credibile saranno escluse dall'universo di investimento.

No



### Quale strategia di investimento segue questo prodotto finanziario?

#### Integrazione ESG:

L'integrazione ESG consiste nel prendere in considerazione i rischi ESG rilevanti nell'ambito del processo di ricerca. L'integrazione ESG consente al Gestore del Portafoglio di identificare i fattori di sostenibilità finanziariamente rilevanti che hanno un impatto sulle decisioni di investimento e di incorporare le considerazioni ESG nell'attuazione delle decisioni di investimento, nonché di monitorare sistematicamente i rischi ESG e di confrontarli con la propensione al rischio e i vincoli. Inoltre, contribuisce alla costruzione del portafoglio attraverso la selezione dei titoli, la convinzione d'investimento e le ponderazioni del portafoglio.

- Per gli emittenti societari, questo processo utilizza un quadro interno di questioni materiali ESG di UBS che identifica i fattori finanziariamente rilevanti per settore che possono avere un impatto sulle decisioni di investimento. Questo orientamento alla materialità finanziaria garantisce che gli analisti si concentrino sui fattori di sostenibilità che possono avere un impatto sulla performance finanziaria dell'azienda e quindi sui rendimenti degli investimenti. L'integrazione ESG può anche identificare le opportunità di impegno per migliorare il profilo di rischio ESG della società e quindi mitigare il potenziale impatto negativo delle questioni ESG sulla performance finanziaria della società. Il Gestore del Portafoglio utilizza un cruscotto interno UBS per il rischio ESG che combina diverse fonti di dati ESG interne ed esterne al fine di identificare le società con rischi ESG rilevanti. Un segnale di rischio attivabile evidenzia i rischi ESG al Gestore di Portafoglio, che li incorpora nel suo processo decisionale di investimento.

- Per gli emittenti non societari, il Gestore del portafoglio applica una valutazione qualitativa o quantitativa del rischio ESG che integra i dati sui fattori ESG rilevanti.

La strategia d'investimento guida le decisioni d'investimento in base a fattori quali gli obiettivi d'investimento e la tolleranza al rischio.



L'analisi delle considerazioni materiali sulla sostenibilità/ESG può includere molti aspetti diversi, come ad esempio: l'impronta di carbonio, la salute e il benessere, i diritti umani, la gestione della catena di fornitura, il trattamento equo dei clienti e la governance.

**Esclusioni specifiche del fondo:**

Il comparto esclude le società con un profilo di sostenibilità che indica un rischio ESG elevato o grave.

**Politica di esclusione della sostenibilità:**

La Politica di esclusione della sostenibilità del Gestore del Portafoglio delinea le esclusioni applicate all'universo d'investimento del prodotto finanziario. Il link alla Politica di esclusione della sostenibilità si trova nel corpo principale del Prospetto di vendita.

● **Quali sono gli elementi vincolanti della strategia utilizzata per selezionare gli investimenti per raggiungere ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse da questo prodotto finanziario?**

I seguenti elementi vincolanti della strategia d'investimento sono utilizzati per selezionare gli investimenti al fine di raggiungere le caratteristiche promosse da questo prodotto finanziario:

Caratteristica 1):

Un profilo di sostenibilità superiore a quello del suo benchmark o un punteggio di consenso UBS ESG compreso tra 7 e 10 (che indica un profilo di sostenibilità forte).

Caratteristica 2):

Un'intensità media ponderata di carbonio (WACI) degli ambiti 1 e 2 inferiore a quella del suo benchmark o un basso profilo di carbonio assoluto.

I calcoli non tengono conto della liquidità, dei derivati e degli strumenti di investimento privi di rating.

L'elemento o gli elementi vincolanti sono calcolati alla fine del trimestre utilizzando la media dei valori di tutti i giorni lavorativi del trimestre.

● **Qual è il tasso minimo impegnato per ridurre la portata degli investimenti considerati prima dell'applicazione di tale strategia di investimento?**

Non applicabile.

● **Qual è la politica di valutazione delle pratiche di buon governo delle società che beneficiano degli investimenti?**

Una buona governance aziendale è un fattore chiave per una performance sostenibile ed è pertanto integrata nella strategia d'investimento del Gestore del Portafoglio. Il Gestore del Portafoglio utilizza un cruscotto di rischio ESG proprietario che combina diverse fonti di dati ESG provenienti da fornitori interni ed esterni riconosciuti al fine di identificare le società con rischi ESG rilevanti. Un segnale di rischio attivabile evidenzia i rischi ESG al Gestore del Portafoglio per incorporarli nel suo processo decisionale di investimento. La valutazione della buona governance comprende l'esame della struttura e dell'indipendenza del consiglio di amministrazione, l'allineamento delle remunerazioni, la trasparenza della proprietà e del controllo e la rendicontazione finanziaria.

Le pratiche di buona governance includono strutture di gestione solide, relazioni con i dipendenti, remunerazione del personale e conformità fiscale.

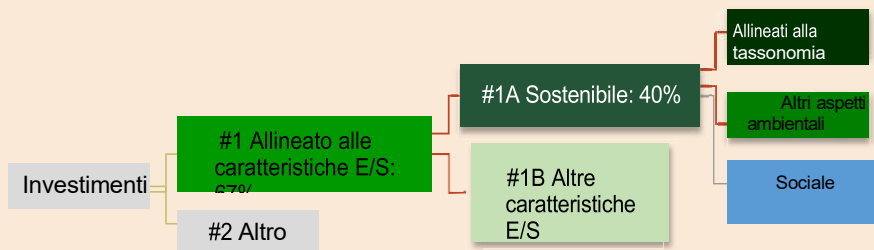
## Qual è l'asset allocation prevista per questo prodotto finanziario?

La percentuale minima di investimenti utilizzati per soddisfare le caratteristiche ambientali e/o sociali promosse dal prodotto finanziario è del 67%. La percentuale minima di investimenti sostenibili del prodotto finanziario è del 40%.

L'asset allocation descrive la quota di investimenti in attività specifiche.

Le attività allineate alla tassonomia sono espresse come quota di:

- fatturato che riflette la quota di ricavi derivanti dalle attività verdi delle società partecipate
- spese in conto capitale (CapEx) che mostrano gli investimenti verdi effettuati dalle imprese che beneficiano degli investimenti, ad esempio per la transizione



**#1 Allineato alle caratteristiche E/S** include gli investimenti del prodotto finanziario utilizzati per raggiungere le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

**#2 Altro** comprende i restanti investimenti del prodotto finanziario che non sono allineati con le caratteristiche ambientali o sociali, né sono qualificati come investimenti sostenibili.

La categoria **#1 Allineati con le caratteristiche E/S** comprende:

- La sottocategoria **#1A Sostenibile** comprende gli investimenti sostenibili con obiettivi ambientali o sociali.
- La sottocategoria **#1B Altre caratteristiche E/S** comprende gli investimenti allineati con le caratteristiche ambientali o sociali che non si qualificano come investimenti sostenibili.

### In che modo l'uso dei derivati raggiunge le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario?

I derivati non sono utilizzati per raggiungere le caratteristiche promosse da questo prodotto finanziario. I derivati sono utilizzati principalmente a fini di copertura e di gestione della liquidità.



### In che misura minima gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale sono allineati alla tassonomia UE?

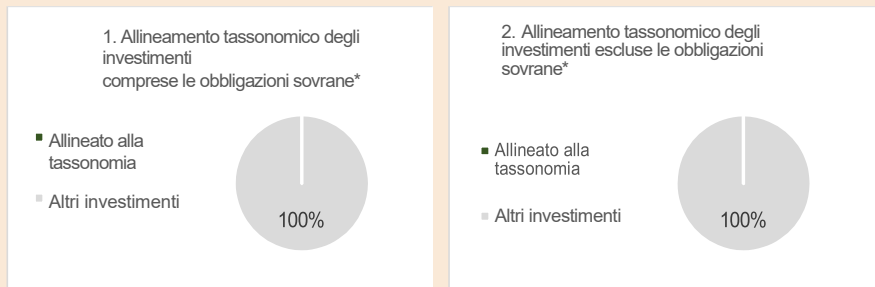
Non è stato possibile raccogliere dati sull'obiettivo o sugli obiettivi ambientali di cui all'articolo 9 del Regolamento sulla Tassonomia e su come e in che misura gli investimenti sottostanti al prodotto finanziario siano in attività economiche qualificate come sostenibili dal punto di vista ambientale ai sensi dell'articolo 3 del Regolamento sulla Tassonomia ("investimenti allineati alla tassonomia"). Su questa base, il prodotto finanziario ha lo 0% di investimenti allineati alla tassonomia.

\*Ai fini di questi grafici, le "obbligazioni sovrane" sono costituite da tutte le esposizioni sovrane

***I due grafici sottostanti mostrano in verde la percentuale minima di investimenti che sono allineati a la tassonomia dell'UE. Poiché non esiste una metodologia appropriata per determinare l'allineamento alla tassonomia dei titoli sovrani\*, il primo grafico mostra l'allineamento alla tassonomia in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario, compresi i titoli sovrani, mentre il secondo grafico mostra l'allineamento alla tassonomia solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dai titoli sovrani.***

Le attività abilitanti consentono direttamente ad altre attività di dare un contributo sostanziale a un obiettivo ambientale.

Le attività transitorie sono attività per le quali non sono ancora disponibili alternative a basse emissioni di carbonio e che, tra l'altro, presentano livelli di emissioni di gas serra corrispondenti alle migliori prestazioni.



● **Qual è la quota minima di investimenti in attività di transizione e abilitazione?**

Non c'è alcun impegno per una percentuale minima di investimenti in attività di transizione e abilitazione.



● **Qual è la quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che non sono allineati alla tassonomia UE?**

Il prodotto finanziario investe in attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale ma non allineate alla Tassonomia UE, a causa dell'assenza della normativa di attuazione richiesta e in particolare dell'assenza dei dati necessari relativi alla tassonomia forniti dalle società partecipate e di una metodologia di calcolo ben definita. Il prodotto finanziario mira a una quota minima di investimenti sostenibili con obiettivo ambientale non allineati alla tassonomia UE superiore allo 0%.



● **Qual è la quota minima di investimenti socialmente sostenibili?**

Il prodotto finanziario mira a una quota minima di investimenti socialmente sostenibili superiore allo 0%.

● **Quali investimenti sono inclusi nella voce "#2 Altro", qual è il loro scopo e sono previste salvaguardie ambientali o sociali minime?**

Nella voce "#2 Altro" sono inclusi contanti e strumenti privi di rating ai fini della gestione della liquidità e del rischio di portafoglio. Gli strumenti privi di rating possono anche includere titoli per i quali non sono disponibili i dati necessari per la misurazione del raggiungimento delle caratteristiche ambientali o sociali.



● **Viene designato un indice specifico come benchmark di riferimento per determinare se questo prodotto finanziario è allineato con le caratteristiche ambientali e/o sociali che promuove?**

Non è stato designato un benchmark di riferimento ESG per determinare se il prodotto finanziario è allineato con le caratteristiche che promuove.

● **In che modo il benchmark di riferimento è costantemente allineato con ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario?**

Non applicabile.

● **Come viene garantito l'allineamento continuo della strategia di investimento con la metodologia dell'indice?**

Non applicabile.

● **In che modo l'indice designato si differenzia da un indice di mercato ampio rilevante?**

Non applicabile.

● **Dove si può trovare la metodologia utilizzata per il calcolo dell'indice designato?**

Non applicabile.

● **Dove posso trovare online ulteriori informazioni specifiche sul prodotto?**

Ulteriori informazioni specifiche sul prodotto sono disponibili sul sito web: [www.ubs.com/funds](http://www.ubs.com/funds)