

## **Disclosure ex art. 10 del Reg. UE 2019/2088 per “Anima Bilanciato Megatrend People”, prodotto che promuove caratteristiche ambientali e sociali secondo l’art. 8 del Reg. citato.**

### **Introduzione**

Il prodotto finanziario promuove caratteristiche ambientali o sociali, ma non ha come obiettivo un investimento sostenibile.

### **Caratteristiche ambientali o sociali del prodotto finanziario**

Il prodotto si propone di limitare la presenza di emittenti caratterizzati da una bassa qualità dal punto di vista sociale e ambientale, anche attraverso l’esclusione di settori industriali controversi e di emittenti governativi sanzionati dall’ONU.

Il prodotto è gestito attivamente.

### **Strategia di investimento**

La strategia ESG del fondo prevede i seguenti elementi vincolanti:

- la selezione ed il monitoraggio dei profili di sostenibilità degli emittenti, in particolare investendo al massimo il 20% del NAV in strumenti caratterizzati da ESG Score per i governativi o ESG Combined Score per i corporate < 25, su una scala che va da zero a 100 (dove 100 è il massimo) o privi di ESG Combined Score;
- l’esclusione di emittenti corporate appartenenti ai settori del tabacco e gioco d’azzardo;
- l’esclusione di emittenti corporate produttori di armi nucleari;
- l’esclusione di emittenti corporate che superano il 30% di ricavi derivanti dal carbone per uso termico.

Inoltre, le limitazioni interne, nell’ottica di mitigare e contenere i rischi di sostenibilità, prevedono l’esclusione:

- degli emittenti direttamente coinvolti nella produzione o commercializzazione di armi controverse proibite da Trattati internazionali;
- degli emittenti governativi sanzionati dall’ONU per violazione dei diritti umani.

Le esclusioni e le limitazioni di cui sopra non si applicano alle posizioni rivenienti da look-through su fondi e derivati su indici in portafoglio.

### **Ripartizione degli investimenti**

Come sopra rappresentato, al massimo il 20% del NAV può essere investito in strumenti caratterizzati da ESG Score per gli emittenti governativi o ESG Combined Score per gli emittenti corporate < 25, su una scala che va da zero a 100 (dove 100 è il massimo) o privi di ESG Combined Score. La componente residuale può essere investita in attività di altra tipologia, che riguardano aziende e paesi ritenuti interessanti dal punto di vista strettamente finanziario e che, date le loro caratteristiche, aiutano a completare il profilo tematico, settoriale e geografico del portafoglio. Da tali investimenti sono comunque esclusi emittenti appartenenti ai settori del tabacco, gioco d’azzardo, produttori di carbone termico per più del 30% dei loro ricavi e produttori di armi

nucleari o controverse o emittenti governativi che siano stati sanzionati dalle Nazioni Unite per gravi violazioni dei diritti umani.

### **Monitoraggio delle caratteristiche ambientali o sociali**

La strategia è perseguita attivamente dal gestore e il suo rispetto è affidato al monitoraggio svolto su base continuativa dalle funzioni di controllo.

### **Metodologia e fonte dati**

ANIMA Sgr valuta il profilo ambientale e sociale del prodotto attraverso l'uso di rating, punteggi ed analisi ESG calcolati e svolti da fornitori specializzati esterni, in particolare:

- Refinitiv, per le valutazioni ambientali e sociali degli emittenti corporate;
- Sustainalytics, per le valutazioni ambientali e sociali degli emittenti governativi e per le esclusioni di quelli sanzionati dall'ONU per violazioni dei diritti umani;
- Vigeo, per le esclusioni di emittenti corporate direttamente coinvolti nella produzione o commercializzazione di armi controverse bandite da trattati internazionali e produttori di armi nucleari.
- Urgewald: per le esclusioni di emittenti che superano il 30% di ricavi derivanti dal carbone per uso termico.

Ulteriori dettagli sulle metodologie di analisi utilizzate possono essere trovati sui siti internet delle aziende menzionate.

### **Limitazioni**

Le principali limitazioni dei metodi di analisi sopra descritti sono rappresentate dal grado di copertura degli emittenti in portafoglio da parte dei fornitori esterni e dalle possibili imprecisioni derivanti dalla normalizzazione di sistemi di misurazione differenti utilizzati dai vari fornitori.

### **Due Diligence**

La corretta applicazione delle valutazioni ESG agli asset del fondo è assicurata dalle modalità di scarico o recepimento informatizzato delle stesse dai provider terzi utilizzati, così come svolte dalla funzione interna di Risk Management.

### **Politica di impegno**

Con riferimento alle pratiche di azionariato attivo, la SGR, oltre ad aderire ai Principi Italiani di Stewardship emessi da Assogestioni sulla base dell'EFAMA Stewardship Code, ha predisposto una politica documentata e disponibile al pubblico (si veda "ANIMA - Politica di impegno") in cui descrive come:

- monitora le società partecipate aventi azioni ammesse alla negoziazione in un mercato regolamentato italiano o di un altro Stato membro dell'Unione europea su questioni rilevanti, compresi la strategia, i risultati finanziari e non finanziari nonché i rischi, la struttura del capitale, l'impatto sociale e ambientale e il governo societario;
- dialoga con le società partecipate;
- esercita i diritti di voto e altri diritti connessi alle azioni;
- collabora con altri azionisti;
- comunica con i pertinenti portatori di interesse delle società partecipate;
- gestisce gli attuali e potenziali conflitti di interesse in relazione al proprio impegno.