

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

| Edizioni del documento |   |
|------------------------|---|
| Data                   | Descrizione   |
| 14/06/2021             | Prima redazione del documento   |
| 01/01/2023             | Aggiornamento ai sensi dell’art. 24 del Regolamento Delegato (UE) 2022/1288 |
| 12/05/2023             | Riformulazione limiti ESG   |

**a) Sintesi**

Il prodotto in oggetto, che è un fondo di fondi, promuove la lotta al cambiamento climatico, il rispetto dei diritti umani, la protezione della salute e del benessere umani, attraverso l’investimento in fondi che a loro volta promuovono caratteristiche ambientali e sociali (art.8 SFDR) o che hanno obiettivi di investimento sostenibile (art.9 SFDR) o in singoli emittenti allineati alle caratteristiche ambientali e sociali promosse. Per quello che riguarda la qualità ESG del prodotto, essa è monitorata in modo da evitare che più del 30% degli asset del prodotto sia investito in strumenti ancillari di liquidità, o in strumenti di emittenti sprovvisti di ESG Combined Score o con un ESG Combined Score inferiore a 25/100, o in fondi non art. 8 o 9 della SFDR. Quindi, almeno il 70% degli asset del prodotto è investito in emittenti che sono allineati alle caratteristiche ambientali e sociali promosse dal prodotto e che sono rappresentati da fondi interni o di terzi art. 8 e art. 9 della SFDR o da eventuali singoli emittenti oggetto di investimento diretto caratterizzati da un ESG Combined Score superiore a 25/100.

Il Gestore fa uso di dati ESG di terzi, che provengono da alcuni fra i più usati e stimati fornitori presenti sul mercato.

**b) Nessun obiettivo di investimento sostenibile**

Questo prodotto finanziario promuove caratteristiche ambientali e sociali, ma non ha come obiettivo investimenti sostenibili.

**c) Caratteristiche ambientali o sociali del prodotto finanziario**

Questo prodotto finanziario promuove la preservazione dell’ambiente e delle risorse naturali, la lotta al cambiamento climatico e all’inquinamento, e/o i diritti umani e sociali e/o la protezione della salute e del benessere umano.

Ulteriori elementi della strategia di prodotto finanziario sono descritti nei successivi paragrafi.

#### **d) Strategia di investimento**

La strategia di investimento sostenibile di questo prodotto finanziario è quella di perseguire su base continuativa la promozione delle caratteristiche ambientali e sociali elencate nel paragrafo iniziale e qui di seguito riportate: la preservazione dell'ambiente e delle risorse naturali, la lotta al cambiamento climatico e all'inquinamento, i diritti umani e sociali e la protezione della salute e del benessere umano. Il perseguimento di tali caratteristiche è realizzato attraverso l'investimento in fondi art. 8 e art. 9 della SFDR o in eventuali singoli emittenti, allineati alle caratteristiche ambientali e sociali promosse da questo prodotto finanziario.

#### **e) Quota degli investimenti**

L'asset allocation strategica del prodotto finanziario è definita dal suo profilo di rischio-rendimento e attuata attraverso la modulazione dei suoi investimenti nel corso del tempo.

Almeno il 70% degli asset del prodotto finanziario è investito in strumenti che promuovono le caratteristiche ambientali e sociali descritte nei paragrafi precedenti e che sono rappresentati da fondi interni o di terzi art. 8 e art. 9 della SFDR o da eventuali singoli emittenti oggetto di investimento diretto caratterizzati da un ESG Combined Score superiore a 25/100.

Fino al 30% degli asset del prodotto finanziario (componente "#2 Altro") può essere investito in fondi non art. 8 o 9 della SFDR, in strumenti di mercato monetario o liquidità, e in strumenti di emittenti sprovvisti di ESG Combined Score o con un ESG Combined Score inferiore a 25/100. Tali strumenti sono ritenuti di interesse da un punto di vista finanziario e, date le loro caratteristiche, aiutano a completare il profilo tematico, settoriale e geografico del portafoglio.

Le soglie sopra menzionate del 70% e del 30% saranno rispettate a meno condizioni di mercato straordinarie e sempre nell'interesse dei sottoscrittori.

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

Le caratteristiche ambientali e sociali sono promosse attivamente dai Portfolio Managers del Gestore, nell'ambito del loro perseguimento attivo della strategia di investimento di questo prodotto finanziario. Il team di Risk Management del Gestore controlla su base continuativa l'aderenza del portafoglio a tali caratteristiche e strategia di investimento, avendo sempre come riferimento i dati ESG resi disponibili dai fornitori terzi utilizzati. Qualunque deviazione dalle linee di indirizzo (dovute per esempio a movimenti dei prezzi o variazioni dei punteggi ESG degli emittenti oggetto di investimento) è analizzata dal Gestore, valutando eventuali interventi sul portafoglio, tenendo sempre in considerazione gli interessi del prodotto e dei suoi sottoscrittori.

**g) Metodologie**

Le metodologie, usate per la valutazione delle caratteristiche ambientali e sociali dei Paesi e delle aziende oggetto di investimento e per l'identificazione degli emittenti soggetti ad esclusione, sono quelle sviluppate dai fornitori terzi utilizzati, tra i quali Refinitiv, Sustainalytics, Moody's-Vigeo, ISS, MSCI, ICE. Ulteriori dettagli sono disponibili sul sito delle società, che sono tra le più conosciute sul mercato e le cui competenze professionali sono la miglior garanzia sulla qualità dei loro dati ESG.

**h) Fonti e trattamento dei dati**

I dati, usati per la valutazione delle caratteristiche ambientali e sociali dei Paesi e delle aziende oggetto di investimento e per l'identificazione degli emittenti soggetti ad esclusione, sono quelli prodotti dai fornitori terzi utilizzati, tra i quali Refinitiv, Sustainalytics, Moody's-Vigeo, ISS, MSCI, ICE. Tali dati sono gestiti e processati elettronicamente, via flussi informatici che connettono direttamente i fornitori terzi con il team di Risk Management del Gestore.

**i) Limitazioni delle metodologie e dei dati**

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.

**j) Dovuta diligenza**

La corretta applicazione delle valutazioni ESG a questo prodotto finanziario è assicurata dalle modalità di scarico o recepimento informatizzato delle stesse dai provider terzi utilizzati, così come svolte dalla funzione interna di Risk Management. Inoltre, gli elementi vincolanti della strategia sono tradotti in limitazioni agli investimenti, che vengono definite dal Comitato ESG del Gestore, approvate dal suo Comitato Prodotti e portate all'attenzione del CdA. Tali restrizioni quantitative sono infine applicate al sistema di controllo limiti dal team di Risk Management.

**k) Politiche 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.

**l) Indice di riferimento**

Non è stato designato un indice di riferimento per soddisfare le caratteristiche ambientali e sociali promosse da questo prodotto finanziario.