

# Top Funds Selection iCARE

## INFORMATIVA SULLA SOSTENIBILITÀ

### Al sensi dell'art. 24 del Regolamento UE 2022/1288

#### Nessun obiettivo di investimento sostenibile

Questo prodotto promuove caratteristiche ambientali/sociali e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, avrà una quota minima del 20% di investimenti sostenibili.

Per la quota di portafoglio investita in investimenti sostenibili, si riportano di seguito gli obiettivi che il Comparto intende realizzare:

- Obiettivi Ambientali: Mitigazione dei cambiamenti climatici;
- Obiettivi sociali: Standard di vita e benessere adeguati.

Al fine di non arrecare un danno significativo a nessun obiettivo di investimento sostenibile sotto il profilo ambientale o sociale che il prodotto intende in parte realizzare, si tiene conto degli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità contenuti nella Tabella 1 "Dichiarazione sui principali effetti negativi delle decisioni di investimento sui fattori di sostenibilità" contenuta nell'Allegato 1 "Modello di dichiarazione dei principali effetti negativi sulla sostenibilità" del Regolamento Delegato 2022/1288 individuati e documentati con approfondite attività di due diligence e/o dichiarati nella documentazione d'offerta dagli Asset Manager degli OICR o ETF selezionati.

Il prodotto effettuando investimenti sostenibili per il tramite di OICR o ETF classificati ex art. 8 ed ex art. 9 del Regolamento UE 2088/2019 garantisce indirettamente per la quota di investimenti sostenibili il rispetto del principio dell'allineamento con le linee guida OCSE destinate alle imprese multinazionali e con i Principi guida delle Nazioni Unite su imprese e diritti umani, inclusi i principi e i diritti stabiliti dalle otto convenzioni fondamentali individuate nella dichiarazione dell'Organizzazione internazionale del lavoro sui principi e i diritti fondamentali nel lavoro e dalla Carta internazionale dei diritti dell'uomo.

## Caratteristiche ambientali o sociali del prodotto finanziario

Il Comparto è un prodotto finanziario che promuove caratteristiche ambientali, sociali e di governance (ESG) ai sensi dell'Articolo 8 del Regolamento (UE) 2019/2088 del Parlamento europeo e del Consiglio del 27 novembre 2019.

Il Comparto promuove caratteristiche ambientali e/o sociali investendo almeno l'80% in OICR o ETF classificati ex artt. 8 e 9 ai sensi del Regolamento (UE) 2019/2088 del Parlamento europeo.

Il Comparto, inoltre, promuove le seguenti caratteristiche:

- Rispetto dei diritti umani;
- Rispetto di convenzioni internazionali relative alle armi controverse.

Il prodotto non ha un indice di riferimento sostenibile.

## Strategia di investimento

La strategia di investimento seguita da questo prodotto mira a selezionare strumenti finanziari capaci di combinare rendimento finanziario e promozione delle caratteristiche ESG.

La strategia di investimento del prodotto è caratterizzata da elementi vincolanti riconducibili a specifici screening negativi e positivi di seguito descritti.

### Screening negativo

Sulla base dei dati forniti dal Provider MSCI il Prodotto non investe in OICR ed ETF con rating MSCI pari a CCC. E' inoltre previsto che:

- non più del 10% del patrimonio del Comparto sia investito in OICR ed ETF con un rating ESG MSCI pari a B;
- non più del 25% del patrimonio del Comparto sia investito in OICR ed ETF privi di rating ESG MSCI.

### Screening Positivo

Al fine di promuovere le caratteristiche ambientali e/o sociali il Fondo investe almeno l'80% in OICR ed ETF classificati ex art. 8 ed ex art. 9 del Regolamento (UE) 2019/2088.

Con riferimento alla quota parte del patrimonio del prodotto investita in investimenti sostenibili si precisa che per gli stessi il conteggio avviene considerando:

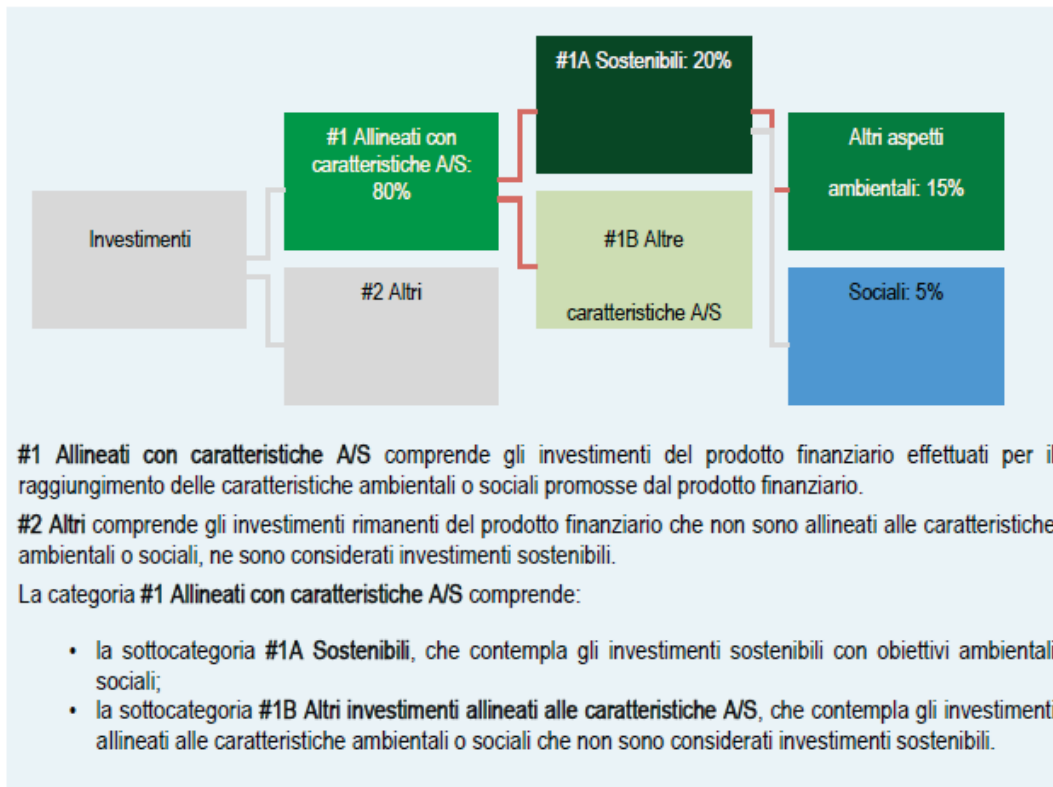
- il 100% per i prodotti classificati ex art. 9 del Regolamento UE 2088/2019;
- la percentuale minima di investimenti sostenibili dichiarata nella documentazione d'offerta per i prodotti ex art. 8 del Regolamento UE 2088/2019.

Il prodotto, effettuando investimenti in OICR o ETF classificati ex art. 8 ed ex art. 9 del Regolamento UE 2088/2019, garantisce indirettamente il rispetto delle prassi di buona governance delle imprese beneficiarie degli investimenti.

## Quota degli investimenti

Questo prodotto finanziario promuove caratteristiche ambientali e sociali per almeno l'80 % del proprio patrimonio con un minimo di investimenti sostenibili con obiettivi ambientali o sociali almeno pari al 20% . Il Comparto investe in OICR ed ETF classificati ex artt. 8 e 9 del Regolamento (UE) 2019/2088, che costituiscono gli investimenti indiretti nei soggetti che

beneficiano degli investimenti. La restante parte del portafoglio potrà essere investita in OICR ed ETF ex art. 6 Regolamento 2088/2019, liquidità e strumenti finanziari derivati.



## Monitoraggio delle caratteristiche ambientali o sociali

La promozione delle caratteristiche ambientali e sociali, così come il perseguimento degli obiettivi di investimento sostenibili che il prodotto intende in parte realizzare, viene attuato mediante l'applicazione di una strategia d'investimento caratterizzata da elementi vincolanti riconducibili a specifici screening negativi e positivi da cui scaturiscono precisi limiti integrati nel sistema di Front Office e monitorati nel continuo dalla Funzione di Risk Management.

Gli indicatori di sostenibilità usati per misurare la promozione delle caratteristiche e il perseguimento degli obiettivi ambientali e sociali che il prodotto intende in parte realizzare sono monitorati lungo l'intero ciclo di vita del prodotto e rendicontati annualmente.

## Metodologie relative alle caratteristiche ambientali o sociali

Si riportano di seguito gli indicatori utilizzati per misurare il rispetto delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal Comparto:

### Indicatore

- % di portafoglio investita in OICR ed ETF ex artt. 8 e 9
- % di portafoglio investita in OICR ed ETF che prevedono politiche di gestione delle violazioni dei diritti umani da parte di emittenti societari
- % di portafoglio investita in OICR ed ETF che prevedono politiche di esclusione di emittenti societari in caso di coinvolgimento nel business delle armi controverse.

La contribuzione al perseguimento degli obiettivi ambientali e sociali che il comparto intende in parte realizzare viene misurata mediante i seguenti indicatori:

Obiettivo	Indicatore
Mitigazione dei cambiamenti climatici	% portafoglio investita in OICR ed ETF esposti su obiettivo
Standard di vita e benessere adeguati	% portafoglio investita in OICR ed ETF esposti su obiettivo

Al fine di monitorare la promozione delle caratteristiche ed il perseguimento degli obiettivi ambientali e sociali che il Comparto intende in parte realizzare la SGR fa riferimento alle informazioni acquisite in sede di due diligence e/o dichiarate nella documentazione d'offerta dagli Asset Manager degli OICR o ETF selezionati.

### Fonti e trattamento dei dati

Per promuovere le caratteristiche ambientali e sociali ed il perseguimento degli obiettivi ambientali e sociali che il Comparto intende in parte realizzare la SGR si avvale dei dati forniti dal provider MSCI. Per gli investimenti in OICR ed ETF la SGR si avvale dei dati acquisiti in sede di due diligence e/o di quanto dichiarato nella documentazione d'offerta.

Tali dati vengono utilizzati per la selezione degli investimenti, il monitoraggio dei principali effetti negativi, la misurazione degli indicatori di sostenibilità.

La qualità dei dati è garantita dal confronto costante con il provider sia per quanto concerne lo studio e la condivisione delle metodologie sottostanti la definizione degli stessi sia per approfondimenti in caso di dati apparentemente anomali.

I dati forniti dal provider MSCI sono in prevalenza stimati.

### Limitazioni delle metodologie e dei dati

I dati sottostanti le metodologie descritte sono prevalentemente stimati ma le misure adottate per garantire la qualità dei dati descritte nella sezione "Fonti e trattamento dei dati" garantiscono che tale limitazione non influisca sul modo in cui sono soddisfatte le caratteristiche ambientali o sociali promosse e sul raggiungimento dell'obiettivo di investimento sostenibile. Eventuali disallineamenti rispetto ai dati stimati potranno verificarsi nel momento in cui gli emittenti societari renderanno pubblici i dati reali.

### Dovuta diligenza

Per la selezione degli investimenti la SGR si avvale dei dati forniti dai provider MSCI nonché delle informazioni acquisite in sede di due diligence e/o dalla documentazione d'offerta per quanto concerne gli OICR ed ETF.

La strategia di investimento è caratterizzata da elementi vincolanti riconducibili a specifici screening negativi e positivi da cui scaturiscono precisi limiti di investimento integrati ex ante nel sistema di Front Office e monitorati ex post nel continuo dalla Funzione di Risk Management.

### Modifiche del documento

Versione	Data	Descrizione modifiche
N.1	30/12/2022	Prima stesura della scheda di Informativa sulla sostenibilità ai sensi dell'art. 24 del Regolamento UE 2022/1288.