



Nota informativa

(depositata presso la COVIP il 21/12/2022)

Appendice

'Informativa sulla sostenibilità' (in vigore dal 22/12/2022)

ARCA FONDI SGR S.p.A. (di seguito ARCA FONDI) è responsabile della completezza e veridicità dei dati e delle notizie contenuti nella presente Nota informativa.

Informazioni sulle caratteristiche ambientali o sociali/investimenti sostenibili

I comparti Rendita Sostenibile, Crescita Sostenibile e Alta Crescita Sostenibile, promuovono caratteristiche ambientali, sociali e di governance (di seguito "ESG") ai sensi dell'Articolo 8 del Regolamento (UE) 2019/2088.

Affinché le caratteristiche ESG dei comparti vengano rispettate, Arca Fondi SGR adotta un approccio rigoroso per il quale, l'80% degli asset in portafoglio dovrà avere un rating ESG, calcolato con una metodologia proprietaria, maggiore o uguale al rating assegnato all'asset class di riferimento. Il punteggio ESG di ogni comparto è calcolato come la media ponderata sull'attivo dei punteggi ESG degli emittenti degli strumenti finanziari in portafoglio. Con tale approccio la SGR, oltre all'integrazione dei rischi di sostenibilità nelle decisioni di investimento, mira ad assicurare che i comparti raggiungano e mantengano un elevato profilo di sostenibilità.

Integrazione dei rischi di sostenibilità

Arca Fondi SGR ha integrato i criteri ESG nei propri processi di investimento al fine di effettuare una valutazione dei rischi di sostenibilità congiuntamente alle valutazioni dei rischi finanziari; tale integrazione oltre a rispondere ai principi ed ai valori della Società, è conseguente all'adesione ai "Principles for Responsible Investment" (PRI), i principi guida sugli investimenti socialmente responsabili (SRI) promossi dalle Nazioni Unite.

Al fine di misurare il rispetto delle caratteristiche ambientali e sociali promosse dai comparti, nonché per assicurare l'aderenza del prodotto ai migliori standard di sostenibilità, la SGR ha sviluppato un modello proprietario che, basandosi sui dati dell'info provider MSCI, considera come indicatori di sostenibilità i tre fattori Environmental, Social e Governance (ESG) combinati per tutti gli strumenti finanziari presenti in portafoglio.

In base a tali score dei singoli strumenti, viene attribuito un rating ai singoli comparti. Il calcolo del Rating ESG di un comparto si basa sulla determinazione della somma pesata dei rating dei titoli in portafoglio, e può assumere valori nel range 0-10. Lo score viene tradotto poi in un rating compreso tra CCC (il grado più basso) e AAA (il grado più alto).

Essendo i comparti sopraindicati classificati come Art. 8, ai sensi del Regolamento (UE) 2019/2088, l'80% degli asset in portafoglio dovrà presentare un rating maggiore o uguale a quello assegnato all'asset class di riferimento.

I titoli degli emittenti valutati come "non in linea con i temi della sostenibilità ambientale, sociale e di governance" non possono, inoltre, essere presenti nei comparti (black list emittenti governativi/settori).

Il Servizio Compliance è incaricato di riscontrare il rispetto dei rating e dei criteri previsti dalla Policy ESG di Arca Fondi SGR e di valutare la necessità di aggiornare la black list, chiedendo il coinvolgimento del Comitato ESG. Gli esiti dei controlli svolti sono prontamente rappresentati alle strutture coinvolte e rendicontati con cadenza periodica mensile al Comitato Rischi e Conformità Normativa, nonché al Consiglio di Amministrazione e con cadenza periodica trimestrale è fornita informativa al Comitato per il Controllo Interno.

Il rispetto della coerenza ai principi ESG dei portafogli è svolto in automatico da specifici algoritmi presenti nei sistemi di controllo di Arca Fondi SGR.

Principali effetti negativi per la sostenibilità delle decisioni di investimento

Sebbene i comparti Rendita Sostenibile, Crescita Sostenibile e Alta Crescita Sostenibile del fondo pensione aperto promuovano caratteristiche ambientali ai sensi dell'articolo 8 della SFDR, al momento non si prevede di investire in alcun "investimento sostenibile" ai sensi della normativa SFDR o del Regolamento sulla Tassonomia (2020/852). Di conseguenza, gli investimenti sottostanti non tengono conto dei criteri UE per le attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale ai sensi del Regolamento sulla Tassonomia. Pertanto, il principio di "non nuocere in modo significativo" non si applica a nessuno degli investimenti dei comparti indicati.