

Informativa articolo 3 del Regolamento (UE) 2019 2088 “SFDR”

(EX Euclidea Sim Spa ora Fürstenberg Società di Intermediazione Mobiliare S.p.A. o, più brevemente, Fürstenberg SIM S.p.A. - Società con socio unico Banca Ifis S.p.A., appartenente al Gruppo Banca Ifis S.p.A., iscritto all'Albo dei Gruppi Bancari, e soggetta all'attività di direzione e coordinamento di Banca Ifis S.p.A.)

Integrazione dei rischi di sostenibilità nei processi decisionali relativi agli investimenti
(Adottata ai sensi dell'articolo 3, comma 1, del Regolamento (UE) 2019/2088 "SFDR")

Il presente documento dettaglia l'informativa ai sensi del Regolamento SFDR in relazione all'integrazione dei Fattori di Sostenibilità nell'ambito dell'attività della Gestione di Portafoglio. I recenti aggiornamenti normativi e la spinta delle istituzioni europee, che hanno avviato, a partire dal 2019, una serie di misure volte a rendere più sostenibile e meno dannosa per l'ambiente la produzione di energia e lo stile di vita dei cittadini europei, con l'obiettivo di trasformare l'UE in una società a impatto climatico "zero" entro il 2050, hanno comportato una crescita dell'interesse dei clienti verso gli investimenti sostenibili, favorendone una diffusione sempre più ampia. Nell'ottica di favorire gli investimenti sostenibili, il Parlamento Europeo ha emanato a fine 2019 il Regolamento 2019/2088 (SFDR), il cui obiettivo è garantire la trasparenza delle informazioni nei confronti degli investitori circa l'integrazione dei rischi di sostenibilità, la considerazione degli effetti negativi delle decisioni di investimento per la sostenibilità, la promozione delle caratteristiche ambientali o sociali e degli Investimenti Sostenibili, ponendo specifici obblighi di trasparenza a carico dei Partecipanti ai Mercati Finanziari e dei Consulenti Finanziari. Inoltre, il Parlamento Europeo ha emanato il Regolamento (UE) 2020/852 (cd. Regolamento sulla Tassonomia) col fine di definire dei criteri uniformi per determinare se un'attività economica possa considerarsi ecosostenibile e individuare il grado di ecosostenibilità di un investimento. Tale regolamento ha definito un sistema di classificazione delle attività economiche dal punto di vista ambientale che avrà una progressiva applicazione attraverso l'adozione di specifici atti delegati contenenti i criteri di vaglio tecnico per la definizione delle modalità di raggiungimento degli obiettivi ambientali definiti.

Il processo di investimento adottato da Euclidea SIM S.p.A. (di seguito anche "Euclidea", "Società" o "SIM") con riferimento alle gestioni di portafoglio prevede, tramite il Team di investimento, l'integrazione dei rischi di sostenibilità sulla base di criteri di negative e positive screening.

Nel contesto del suo processo di investimento, Euclidea considera una gamma di parametri di rischio e rendimento nonché le informazioni sulla sostenibilità nelle scelte di investimento nell'ambito del servizio di gestione di portafoglio.

Euclidea mira a ridurre il rischio finanziario derivante dai rischi di sostenibilità attraverso il monitoraggio delle informazioni sulle caratteristiche ESG ricavate dai dati forniti dagli asset Manager e dal flusso EET fornito da Allfunds Bank, applicando a tutte le scelte di investimento specifici criteri di screening negativi ESG ("Negative screening") degli ETF/UCITS Target.

In particolare, Euclidea verifica che le linee di gestione escludano quote di ETF/UCITS Target che investano in emittenti caratterizzati da:

- significativi ricavi (superiori al 45%) in attività controverse, come Tabacco, Combustibili Fossili, Gioco d'Azzardo, Armi non convenzionali nello specifico mine antiuomo, armi nucleari, armi chimiche e batteriologiche.
- gravi controversie sociali, ambientali e di governance.

Al fine di valutare il rispetto dei suddetti criteri di esclusione, la SIM esamina la documentazione pubblicata ai sensi del Regolamento SFDR da parte delle fund house terze o da fonti terze, sia ex ante che ex post.

Per le linee di gestione "ESG", la SIM combina i criteri di negative screening con criteri di positive screening verificando che, sulla base dei dati in suo possesso come sopra indicato, lo score ESG degli

ETF/UCITS Target di cui il portafoglio si compone sia superiore a 50/100, soglia definita e approvata dal Cda.

Per maggiori informazioni sui criteri e principi adottati dalla SIM circa l'integrazione dei rischi e dei fattori di sostenibilità nei processi decisionali relativi agli investimenti si rimanda alla Policy di Sostenibilità della Società pubblicata sul sito web.

