

# ZurichPortfolio *Solution*

## **Informativa sulla sostenibilità ai sensi dell'art. 10 del Regolamento UE 2019/2088 – Linea Portfolio Solution Dinamica ESG**

La Linea Portfolio Solution Dinamica ESG del prodotto Zurich Portfolio Solution promuove caratteristiche ambientali e/o sociali ai sensi dell'art 8 del regolamento UE 2019/2088 e non ha come obiettivo investimenti sostenibili. In particolare, gli OICR che compongono la Linea Portfolio Solution Dinamica ESG sono selezionati e monitorati con particolare attenzione ai temi di sostenibilità.

La Linea è composta prevalentemente da OICR che promuovono i fattori di sostenibilità ambientale, sociale e di governance (ESG), appartenenti a categorie del mercato azionario e obbligazionario con un'allocazione variabile su base trimestrale. All'interno delle categorie azionarie e obbligazionarie, Zurich seleziona gli OICR più idonei a rappresentare la Linea attraverso un processo di classificazione che tiene conto delle risultanze di analisi di tipo quantitativo (come ad esempio la valutazione delle performance passate), e qualitativo (come ad esempio la valutazione della qualità del gestore) a cui si aggiunge una valutazione complessiva del profilo di sostenibilità dei singoli OICR.

A tal fine, Zurich analizza e monitora il profilo di sostenibilità di ciascun OICR attraverso l'utilizzo di consulenti specializzati e di rating quantitativi forniti da data provider esterni riconosciuti sul mercato (MSCI ESG Rating<sup>®</sup>). In particolare, nella Linea Portfolio Solution Dinamica ESG è prevista l'ammissione, in misura prevalente, di OICR che promuovono caratteristiche ambientali e/o sociali e che hanno come obiettivo investimenti sostenibili ai sensi degli articoli 8 e 9 del Regolamento UE 2019/2088. Inoltre, tali OICR devono essere dotati di rating minimo MSCI ESG Rating<sup>®</sup> pari a "BBB" per tutte le categorie ad eccezione della categoria "Debito Paesi Emergenti" per la quale la soglia minima è pari a "BB" mentre complessivamente la Linea Portfolio Solution Dinamica ESG avrà un rating MSCI ESG <sup>®</sup> pari o superiore ad "A". Il rispetto di tali criteri di ammissibilità è verificato in fase di selezione e monitorato nel continuo. Eventuali interventi sugli OICR che compongono la Linea Portfolio Solution Dinamica ESG sono effettuati in occasione del ribilanciamento trimestrale.