

# salone.SRI The importance of being ESG

November 16, 2021  
Milan, Palazzo Stelline

Finance looking  
for ESG Identity



EVENTO DI

PREMIAZIONE

**16 novembre**  
**13.00 – 14.00 cet**



# salone.SRI The importance of being ESG

November 16, 2021  
Milan, Palazzo Stelline

Finance looking  
for ESG Identity



## SRI AWARDS 2021

*Durante la sesta edizione del salone.SRI verranno assegnati gli SRI Awards a cinque categorie di fondi Sri (socially responsible investing) distribuiti in Italia, agli Etf Sri e alla miglior Sgr in termini di Esg Identity.*

*Il premio riconosce il massimo livello raggiunto dal prodotto per combinazione dei parametri di responsabilità e di performance. L'evento sarà occasione per riflettere sulle modalità di valutazione anche da parte delle società in cui investono i fondi*

Presentazione e scenario | Luca Testoni, ETicaNews

DELOITTE LEGAL

Premiazioni

# INDICE

1. **Gli SRI Awards, presentazione**
2. **Intervento a cura di Deloitte Legal**
3. **Premiazioni**

1. **Gli SRI Awards, presentazione**
- 2.
- 3.

# SRI **A**wards 2021

V edizione  
Salone SRI - 16 novembre 2021

*ESG score by*

**MSCI** 

*presentati con*

**Deloitte.**  
Legal

*partner tecnico*

**MONEYMATE**



## *Definizione del campione – FONDI*

- ❑ Sono stati considerati i fondi appartenenti all'Atlante Sri di ETicaNews, composto da fondi istituzionali e retail distribuiti in Italia che soddisfano almeno una delle seguenti condizioni:
  - i fondi con esplicito mandato Sri
  - i fondi il cui tema è strettamente legato ad almeno uno dei fattori ESG
  - i green bond fund

Al 30/09/2021 i fondi censiti nell'Atlante Sri sono 780 per oltre 2.800 classi

- ❑ Requisiti necessari: sono stati presi in considerazione solamente i fondi con un track record di 3 anni al 30/09/2021 e che al contempo soddisfano i criteri per aggiudicarsi lo score ESG di MSCI

## Definizione del campione - FONDI

- ❑ I fondi che concorrono agli Awards sono **1200**
- ❑ I fondi del campione sono stati raggruppati in 5 categorie:

Categoria ETicaNews	Numero Fondi
Fondi SRI Azionari	564
Fondi SRI Bilanciati e Flessibili	129
Fondi SRI Obb. Corporate	166
Fondi SRI Obb. Governativi	76
Fondi SRI Tematici	262

- ❑ Le società analizzate complessivamente nel campione sono **78**

## Definizione del campione - ETF

- ❑ Sono stati considerati gli Etf appartenenti all'Atlante Sri di ETicaNews, composto da tutti gli Etf quotati su ETFplus di Borsa Italiana che soddisfano almeno una delle seguenti condizioni:
  - Etf con esplicito mandato Sri
  - Etf il cui tema è strettamente legato ad almeno uno dei fattori ESG

Al 30/09/2021 gli Etf censiti nell'Atlante Sri sono 292

- ❑ Requisiti necessari: sono stati presi in considerazione solamente gli Etf con un track record di 3 anni al 30/09/2021 e che al contempo soddisfano i criteri per aggiudicarsi lo score ESG di MSCI
- ❑ Gli Etf che concorrono agli Awards sono **63**
- ❑ Le società analizzate complessivamente nel campione sono **10**



## Metodologia per il calcolo degli Awards (prodotti)

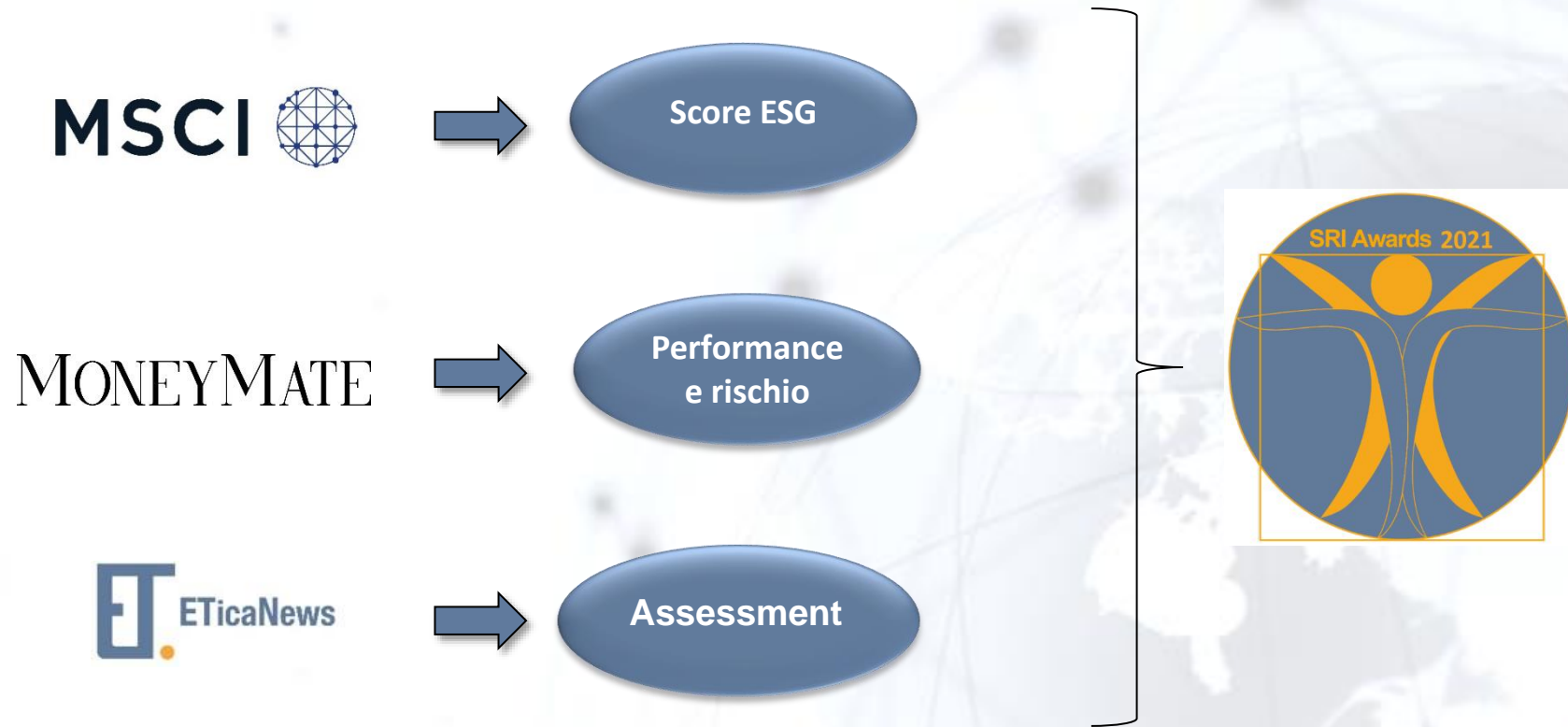
**Premio ai fondi:** all'interno di **ogni categoria** vengono considerate 3 aspetti:

- Score ESG di MSCI
- Rilevazioni a tre anni (dati al 30/09/2021) su database MoneyMate di performance (in euro) e deviazione standard
- Assessment ad opera di ETicaNews in termini di governance e approccio SRI delle case di gestione

Facendo la somma dei punteggi ponderati relativi ai tre aspetti sopra citati, il fondo con punteggio più alto si aggiudica l'award

**Premio agli Etf:** identica metodologia adottata per i fondi, applicata sul totale del campione ottenuto, a prescindere dalla categoria di appartenenza

## Metodologia per il calcolo degli Awards (prodotti)



## ASSESSMENT



- 1.
2. **Intervento a cura di Deloitte Legal**
- 3.

- 1.
- 2.
3. **Premiazioni**







## Categoria: Fondi Azionari

NN (L) European  
Sustainable Equity

DPAM Invest B Equities World  
Sustainable



Candriam Equities L Europe  
Innovation



Primo classificato:

**NN INVESTMENT PARTNERS**  
NN (L) European Sustainable Equity

## Categoria: Fondi Bilanciati e Flessibili

**NN (L) Patrimonial Balanced  
European Sustainable**

**Eurizon AM Sicav Social 4 Planet**



**Raiffeisen Bilanciato  
Sostenibile**



**Primo classificato:**

**NN INVESTMENT PARTNERS**

**NN (L) Patrimonial Balanced European Sustainable**

## Categoria: Fondi Obbligazionari Corporate

Aberdeen Standard SICAV II  
Euro Corporate Bond Sustainable  
and Responsible Investment



Allianz Euro Credit SRI



BMO Responsible Euro  
Corporate Bond



Primo classificato:

**ALLIANZ GLOBAL INVESTORS**

Allianz Euro Credit SRI

## Categoria: Fondi Obbligazionari Governativi

Candriam Sustainable  
Bond Global



JSS Sustainable Bond  
Euro Broad



*ex aequo*

BNP Paribas Funds Sustainable Euro Bond  
BSF ESG Euro Bond Fund



Primo classificato:

**J. SAFRA SARASIN**

JSS Sustainable Bond - Euro Broad

# Categoria: Fondi Tematici

**M&G (Lux) Global Listed  
Infrastructure Fund**

**BlackRock Global Funds  
Sustainable Energy**



**Jupiter Global Ecology  
Growth**



**Primo classificato:**

**M&G INVESTMENTS**

**M&G (Lux) Global Listed Infrastructure Fund**



## Categoria: ETF

Xtrackers MSCI Europe ESG

BNP Paribas Easy MSCI Europe  
SRI S-Series 5% Capped



Amundi Index MSCI Europe SRI



Primo classificato:

**DWS**

Xtrackers MSCI Europe ESG



## Categoria: Società di gestione

**NORDEA ASSET MANAGEMENT**

**NN INVESTMENT PARTNERS**



**ALLIANCEBERNSTEIN**



Primo classificato:

**NORDEA ASSET MANAGEMENT**

# SRI Awards 2021

Categoria: Fondi Azionari

NNIP

Categoria: Fondi Bilanciati e Flessibili

NNIP

Categoria: Fondi Obbl. Corporate

ALLIANZ GLOBAL INVESTORS

Categoria: Fondi Obbl. Governativi

J. SAFRA SARASIN

Categoria: Fondi Tematici

M&G INVESTMENTS

Categoria: ETF

DWS

Categoria: Società di gestione

NORDEA ASSET MANAGEMENT

**GRAZIE**