



SALONE.SRI

IT'S TIME TO WEIGH PRODUCTS, STRATEGIES AND PLAYERS

MILANO, PALAZZO DELLE STELLINE



EVENTO DI PREMIAZIONE



14 novembre
19.00 – 20.00





SALONE.SRI

IT'S TIME TO WEIGH PRODUCTS,
STRATEGIES AND PLAYERS

MILANO, PALAZZO DELLE STELLINE



SRI AWARDS 2022

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

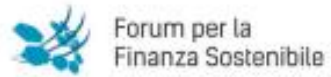
Il premio riconosce il massimo livello raggiunto dal prodotto per combinazione dei parametri di responsabilità e di performance. L'evento sarà occasione per riflettere sulle modalità di valutazione anche da parte delle società in cui investono i fondi

Presentazione e scenario | Luca Testoni, *ET.Group*

DELOITTE LEGAL

Josephine Romano
Barbara Pontecorvo
Guerino Cipriano
Giorgio Mariani

Premiazioni



INDICE

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





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





SRI Awards 2022

VI edizione
salone.SRI - 14 novembre 2022

ESG score by



presentati con



partner tecnico





Definizione del campione – FONDI

- Sono stati considerati i fondi appartenenti all'atlante.SRI di ET.Group, 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 30/09/2022 i fondi censiti nell'atlante.SRI sono circa 3.000, riconducibili a 835 comparti

- Requisiti necessari: sono stati presi in considerazione solamente i fondi con un track record di 3 anni al 30/09/2022 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 **1710**
- ❑ I fondi del campione sono stati raggruppati in 5 categorie:

Categoria ET.Group	Numero Fondi
Fondi SRI Azionari	650
Fondi SRI Bilanciati e Flessibili	221
Fondi SRI Obb. Corporate	280
Fondi SRI Obb. Governativi	121
Fondi SRI Tematici	437

- ❑ Le società analizzate complessivamente nel campione sono **89**



Definizione del campione - ETF

- ❑ Sono stati considerati gli Etf appartenenti all'atlante.SRI di ET.Group, 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
 - Etf che investono in green bond

Al 30/09/2022 gli Etf censiti nell'Atlante Sri sono 460

- ❑ Requisiti necessari: sono stati presi in considerazione solamente gli Etf con un track record di 3 anni al 30/09/2022 e che al contempo soddisfano i criteri per aggiudicarsi lo score ESG di MSCI
- ❑ Gli Etf che concorrono agli Awards sono **104**
- ❑ Le società analizzate complessivamente nel campione sono **12**

Metodologia per il calcolo degli Awards (prodotti)



Premio ai fondi: all'interno di **ogni categoria** vengono considerate 3 aspetti, ciascuno con il relativo peso percentuale:

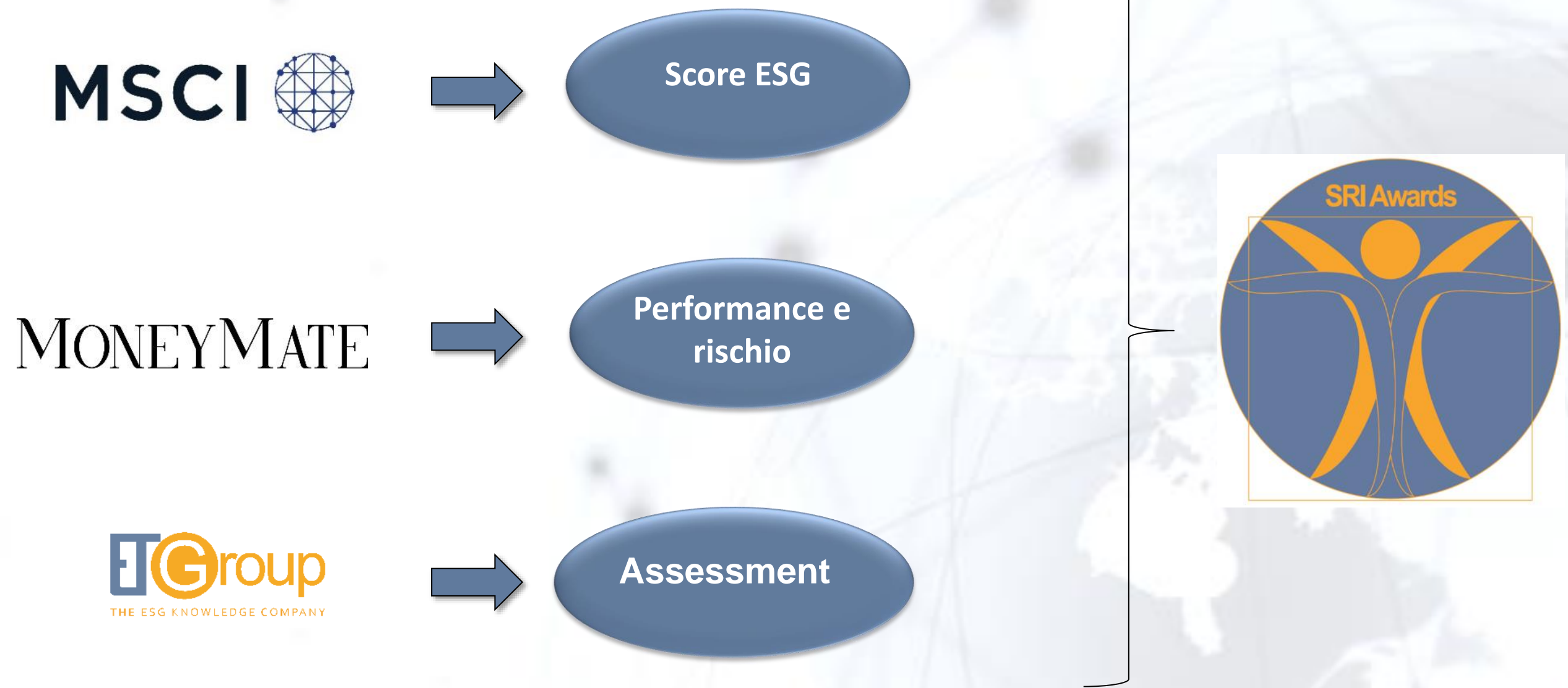
- Score ESG di MSCI
- Rilevazioni a tre anni (dati al 30/09/2022) su database MoneyMate di performance (in euro) e deviazione standard
- Assessment ad opera di ET.Group in termini di governance e approccio SRI delle case di gestione

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, suddivisi in **due categorie**, Etf Azionari e Etf Obbligazionari



Metodologia per il calcolo degli Awards (prodotti)





ASSESSMENT



Metodologia per il calcolo degli Awards (ESG Identity)



Premio Società di gestione: la metodologia utilizzata per l'assegnazione del premio integra

- Il modello di analisi ESG.IAMA - ESG Identity Asset Management Assessment*
- l'analisi dell'offerta complessiva, tenendo in considerazione anche gli approcci

Sono state analizzate 110 società di gestione

Con ESG Identity si intende l'insieme degli elementi distintivi di un soggetto, a partire dalla sua struttura organizzativa (la governance) per arrivare alla coerenza e consistenza ESG della sua offerta al mercato, passando per le modalità con cui il soggetto pensa (la cultura aziendale ESG) e si impegna sul fronte sostenibile (il suo scopo ESG).

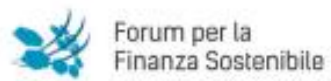
*L'analisi è stata sviluppata in due modalità:

- attraverso l'invio di una survey a giugno la cui raccolta dati è terminata a fine settembre
- Attraverso una desk analysis per chi non ha compilato il questionario



- 1.
- 2.
- 3.

Intervento a cura di Deloitte Legal



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







Categoria: Fondi Azionari



Schroder ISF
Global Sustainable Growth

DWS Invest CROCI World SDG



M&G (Lux) Global Sustain
Paris Aligned



Primo classificato:
SCHRODERS
Schroder ISF Global Sustainable Growth





Categoria: Fondi Bilanciati e Flessibili



Swisscanto (LU) Portfolio Fund
Responsible Balance (CHF)

ex aequo

Swisscanto (LU) Portfolio Fund
Responsible Relax (CHF)

Eurizon AM SICAV Social 4 Future

Eurizon AM SICAV Social 4 Planet



Primo classificato:
SWISSCANTO
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)





Categoria: Fondi Obbligazionari Corporate



UBS (Lux) SICAV 2 - CHF
Bond Sustainable

AXA World Funds Euro
Sustainable Credit

CT Columbia Threadneedle
(Lux) Responsible Euro
Corporate Bond



Primo classificato:
UBS ASSET MANAGEMENT
UBS (Lux) SICAV 2 - CHF Bond Sustainable





Categoria: Fondi Obbligazionari Governativi



Raiffeisen Obbligazionario
PAXetBONUM

Raiffeisen Obbligazionario
Sostenibile

BNY Mellon Sustainable
Global Dynamic Bond



Primo classificato:
RAIFFEISEN CAPITAL MANAGEMENT
Raiffeisen Obbligazionario PAXetBONUM





Categoria: Fondi Tematici



Schroder ISF
Healthcare Innovation

BNP Paribas Aqua



NN (L) Health Care



Primo classificato:

SCHRODERS

Schroder ISF Healthcare Innovation





Categoria: ETF Azionari



**BNP Paribas EASY MSCI WORLD
SRI S-Series PAB 5% Capped**

**BNP Paribas EASY MSCI Japan ESG
Filtered Min TE**

**UBS ETF (IE) Global
Gender Equality**



Primo classificato:
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT
BNP Paribas EASY MSCI WORLD SRI S-Series PAB 5% Capped





Categoria: ETF Obbligazionari



UBS ETF (LU) Sustainable Development Bank Bonds

Amundi Index US Corp Sri



Lyxor Euro Floating Rate Note



Primo classificato:

UBS ASSET MANAGEMENT

UBS ETF (LU) Sustainable Development Bank Bonds





Categoria: Società di gestione



ALLIANZ GLOBAL INVESTORS

LEGAL & GENERAL
INVESTMENT MANAGEMENT

SCHRODERS



Primo classificato:
ALLIANZ GLOBAL INVESTORS





SRI Awards 2022



Categoria: Società di gestione

ALLIANZ GI

LGIM

SCHRODERS

Categoria: Fondi Azionari

SCHRODERS

DWS

M&G INVESTMENTS

Categoria: Fondi Bilanciati e Flessibili

SWISSCANTO

EURIZON

Categoria: Fondi Tematici

SCHRODERS

BNP PARIBAS AM

NNIP

Categoria: Fondi Obbl. Corporate

UBS AM

AXA IM

COLUMBIA THREADNEEDLE INV.

Categoria: Fondi Obbl. Governativi

RAIFFEISEN CAPITAL MANAGEMENT

BNY MELLON IM

Categoria: ETF Azionari

BNP PARIBAS AM

UBS AM

Categoria: ETF Obbligazionari

UBS AM

AMUNDI ETF





GRAZIE

