

@salone.SRI  
Reloaded  
November 24, 2020



EVENTO DI

PREMIAZIONE

**24 novembre**  
**13.00 – 14.00 cet**



ESG Score by

**MSCI**

Partner tecnico

**MONEYMATE**

@salone.SRI  
Reloaded  
November 24, 2020



## SRI AWARDS 2020

*Durante la quinta edizione del @salone.SRI reloaded verranno assegnati gli SRI Awards a cinque categorie di fondi Sri (socially responsible investing) distribuiti in Italia, agli Etf Sri e alla miglior Sgr. 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 investite dai fondi, grazie al contributo di Georgeson.*

Presentazione e scenario | Luca Testoni, ETicaNews

L'azione responsabile di un fondo SRI  
**GEORGESON** | Alberto D'Aroma, Head of Corporate Governance Italy

Premiazioni

ESG Score by



Partner tecnico

MONEYMATE



# INDICE

1. Gli SRI Awards, presentazione
2. L'azione responsabile di un fondo SRI
3. Premiazioni



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





# SRI **A**wards 2020

quarta edizione - Salone SRI  
24 novembre 2020

ESG Score by

**MSCI** 

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 30/09/2020 i fondi censiti nell'Atlante Sri sono 2039

- ❑ Requisiti necessari: sono stati presi in considerazione solamente i fondi con un track record di 3 anni al 30/09/2020 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 **863**

❑ I fondi del campione sono stati raggruppati in 5 categorie:

Categoria ETicaNews	Numero Fondi
Fondi SRI Azionari	425
Fondi SRI Bilanciati e Flessibili	77
Fondi SRI Obb. Corporate	99
Fondi SRI Obb. Governativi	57
Fondi SRI Tematici	206

❑ Le società analizzate complessivamente nel campione sono **72**



## Definizione del campione - ETF

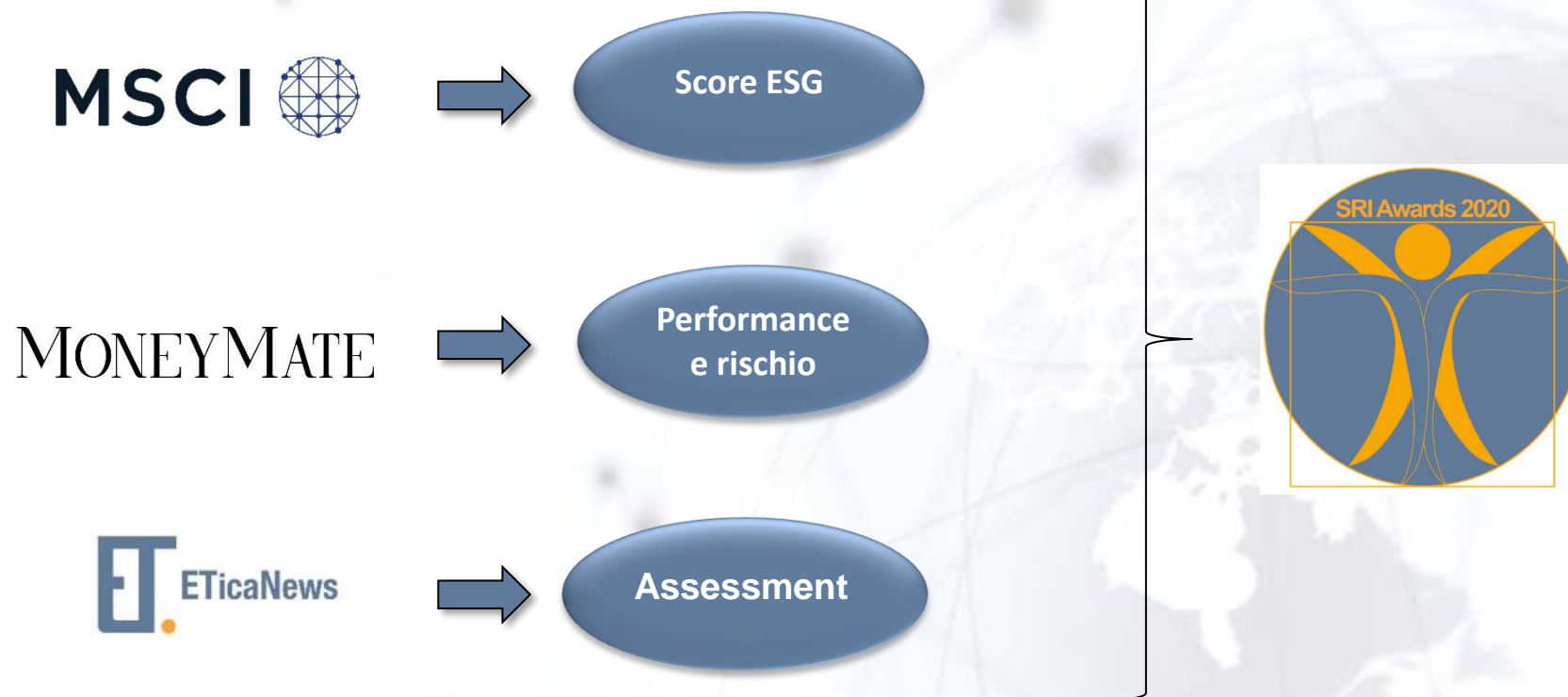
- ❑ Sono stati considerati gli Etf appartenenti all'Atlante Sri di ETicaNews, composto da tutti gli Etf quotati su ETFplus di Borsa Italiana che soddisfano almeno una delle seguenti condizioni:
  - Etf con esplicito mandato Sri
  - Etf il cui tema è strettamente legato ad almeno uno dei fattori ESG

Al 30/09/2020 gli Etf censiti nell'Atlante Sri sono 157

- ❑ Requisiti necessari: sono stati presi in considerazione solamente gli Etf con un track record di 3 anni al 30/09/2020 e che al contempo soddisfano i criteri per aggiudicarsi lo score ESG di MSCI
- ❑ Gli Etf che concorrono agli Awards sono **30**
- ❑ Le società analizzate complessivamente nel campione sono **7**



## Metodologia per il calcolo degli Awards



## Metodologia per il calcolo degli Awards



**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 30/09/2020) 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



## ASSESSMENT





- 1.
2. **L'azione responsabile di un fondo SRI**
- 3.



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





## Category: Equity Funds



DPAM Invest B Equities  
World Sustainable

BMO Responsible  
Global Equity



Fidelity Funds  
Sustainable Global Equity



1st Place:

**DPAM**

DPAM Invest B Equities World Sustainable



## Category: Balanced and Flexible Funds



Raiffeisen Bilanciato  
Sostenibile

Jupiter Global Ecology Diversified



Raiffeisen Sostenibile  
Solidità



1st Place:

**RAIFFEISEN CAPITAL MANAGEMENT**

Raiffeisen Bilanciato Sostenibile



## Category: Corporate Bond Funds



**NN (L) Euro Sustainable  
Credit**

**Candriam Sustainable Euro  
Corporate Bonds**



**BNP Paribas Sustainable  
Euro Corporate Bond**



**1st Place:**

**NN INVESTMENT PARTNERS**

**NN (L) Euro Sustainable Credit**



## Category: Governative Bond Funds



DPAM L Bonds Government  
Sustainable Hedged

Candriam SRI Bond Global



HSBC RIF SRI Euro Bond



1st Place:

**DPAM**

DPAM L Bonds Government Sustainable Hedged





## Category: Thematic Funds



HSBC GIF Global Equity  
Climate Change

RobecoSAM Sustainable  
Healthy Living



Mirova Europe  
Environmental Equity



1st Place:

**HSBC GLOBAL ASSET MANAGEMENT**

HSBC GIF Global Equity Climate Change



## Category: ETF



iShares MSCI Japan SRI

iShares MSCI Europe SRI



UBS ETF (LU) MSCI World  
Socially Responsible



1st Place:

**ISHARES BY BLACKROCK**

iShares MSCI Japan SRI



## Category: Best Sri Asset Management



DPAM

CANDRIAM



NORDEA ASSET  
MANAGEMENT



1st Place:

**DPAM**



# SRI Awards 2020



DPAM

RAIFFEISEN C.M.

NNIP

DPAM

HSBC GLOBAL A.M.

ISHARES BY BLACKROCK

DPAM

Category: Equity Funds

Category: Balanced and Flexible Funds

Category: Corporate Bond Funds

Category: Governative Bond Funds

Category: Thematic Funds

Category: ETF



Category: Best Sri Asset Management



# GRAZIE