

Linea Crescita Equilibrata

ESG report

31 marzo 2024

REPORT RISCHI ESG

Questo report analizza i punteggi ESG della Linea di Gestione Patrimoniale Soprarno **Crescita Equilibrata** al **31 marzo 2024** indicando con quali modalità la gestione soddisfa le caratteristiche ambientali o sociali promosse dalla stessa.

Vengono considerati tutti i risultati di punteggio ESG per la valutazione del profilo dei Rischi di Sostenibilità relativo a tutti gli emittenti appartenenti ai diversi settori in cui la Gestione Patrimoniale investe.

I punteggi vanno da 1 (peggiore) a 100 (migliore).

OBIETTIVO

La Linea di Gestione Patrimoniale promuove caratteristiche ambientali e sociali, ma non ha come obiettivo un investimento sostenibile, in conformità con l'art 8 del Regolamento UE 2019/2088.

PANORAMICA

LA SGR utilizza le informazioni fornite da un primario data provider esterno (Clarity AI), che valuta il rischio di sostenibilità degli emittenti da un punto di vista dell'esposizione ai rischi ambientali (E-Environmental), sociali (S-Social) e di governo d'impresa (G-Governance), assegnando un rating per ogni singolo emittente. Nella valutazione di tali rischi, lo score esamina ed assegna un punteggio a ciascuna caratteristica ambientale e sociale promossa dalla Linea. Il rating finale, in forma aggregata, in ottica prudenziale, tiene conto anche delle controversie che gravano sulle singole società in portafoglio.

Il risultato del punteggio del rischio ESG del Fondo tiene conto della materialità finanziaria di un'ampia gamma di Fattori di Sostenibilità relativi all'operatività dei vari emittenti. Il rischio ESG complessivo di un emittente è calcolato sulla base della media dei punteggi ambientali(E), sociali(S) e di governance(G).

I punteggi sono calcolati considerando le **3552** società emittenti governativi ETF e OIVCM presenti in portafoglio con un Coverage pari al **87.73%**. Sono prese in considerazione per il calcolo del punteggio ESG totale solo gli emittenti di cui si ha almeno il 25% di dati rilevanti.

La presente Linea alla data di riferimento è investita per il **76.67%** in prodotti classificati ex.art.8 o art.9 secondo il Regolamento UE 2019/2088.

RISCHIO ESG



DISCLAIMER

Questa è una comunicazione di marketing. Si prega di richiedere il Documento Informativo Precontrattuale e il Contratto della Linea, prima di prendere una decisione finale di investimento.

La decisione di investire nella Linea dovrebbe tenere conto di tutti gli obiettivi e le caratteristiche descritte nel relativo Documento.

Di seguito i collegamenti al sito web di Soprarno SGR dove sono disponibili informazioni più dettagliate anche sugli aspetti relativi alla sostenibilità, ai sensi del regolamento (UE) 2019/2088:

<https://www.soprarnosgr.it/>

<https://www.soprarnosgr.it/sostenibilita>

In allegato la scheda prodotta dal Data Provider Clarity AI.

GLOSSARIO

- **ESG:** indica gli aspetti ambientali, sociali e di governance.
- **Regolamento (SFDR):** indica il Regolamento (UE) 2019/2088 del Parlamento europeo e del Consiglio del 27 novembre 2019 relativo all'informativa sulla sostenibilità nel settore dei servizi finanziari.
- **Fattori di Sostenibilità:** indica le problematiche ambientali, sociali e concernenti il personale, il rispetto dei diritti umani e le questioni relative alla lotta alla corruzione attiva e passiva.
- **Rischi di Sostenibilità:** indica un evento o una condizione di tipo ambientale, sociale o di governance che, se si verificasse, potrebbe provocare un significativo impatto negativo effettivo o potenziale sul valore dell'investimento, compresi, a titolo esemplificativo ma non esaustivo, i rischi derivanti dai cambiamenti climatici, esaurimento delle risorse naturali, degrado ambientale, violazione dei diritti umani, abuso d'ufficio e corruzione, problematiche sociali e concernenti il personale.
- **Investimento Sostenibile:** indica un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale, misurato, ad esempio, mediante indicatori chiave di efficienza delle risorse concernenti l'impiego di energia, l'impiego di energie rinnovabili, l'utilizzo di materie prime e di risorse idriche e l'uso del suolo, la produzione di rifiuti, le emissioni di gas a effetto serra nonché l'impatto sulla biodiversità e l'economia circolare o un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo sociale, in particolare un investimento che contribuisce alla lotta contro la disuguaglianza, o che promuove la coesione sociale, l'integrazione sociale e le relazioni industriali, o un investimento in capitale umano o in comunità economicamente o socialmente svantaggiate a condizione che tali investimenti non arrechino un danno significativo a nessuno di tali obiettivi e che le imprese che beneficiano di tali investimenti rispettino prassi di buona governance, in particolare per quanto riguarda strutture di gestione solide, relazioni con il personale, remunerazione del personale e rispetto degli obblighi fiscali.

ESG RISK REPORT

This report analyzes the ESG score of SOPRARNO LINEA CRESCITA EQUILIBRATA 31-03-2024 as of April 9, 2024. It shows all ESG scores for ESG Risk Industry Consensus All Companies scoring profile. Range from 1 (worst) to 100 (best).

OVERVIEW

The ESG Risk scores assesses the financial materiality of a wide range of topics related to how the organizations operate. A company's score is calculated from the average of the Environmental, Social, and Governance scores, weighted based on the selected Scoring Profile.

Scores are calculated with 3,161 out of 3,552 organizations. Only organizations with at least 25% data relevance are included to calculate the total score. In the Best in Class method, the score of each company is calculated by comparing it to its industry peers.



ESG RANKING BY SECURITIES

Scores are calculated using the Scoring Profile: ESG Risk Industry Consensus All Companies. Securities are ordered by total score. Only includes securities with >25% data relevance for the selected scoring profile.

Top 5 Securities by score

Security	Portfolio weight	Security Type	Total ESG
SPDR STOXX Europe 600 ...	2.15 %	Fund	74 ●
Lazard Credit FI SRI PVC	2.99 %	Fund	73 ●
Vanguard ESG EUR Corp...	3.46 %	Fund	71 ●
Invesco NASDAQ-100 ES...	4.07 %	Fund	70 ●
Soprarno Esse Stock B	3.61 %	Fund	70 ●

Bottom 5 Securites by score

Security	Portfolio weight	Security Type	Total ESG
Vanguard USD Emerging...	4.02 %	Fund	52 ●
Luxembourg Selection F...	2.04 %	Fund	56 ●
MULTI UNITS LUXEMBO...	1.73 %	Fund	61 ●
Soprarno Pronti Termine...	9.83 %	Fund	63 ●
iShares EUR Govt Bond 1...	3.89 %	Fund	63 ●

DISCLAIMER

Copyright © 2023 Clarity AI. All rights reserved.

The information contained in this document is the property of Clarity AI Inc. and/or the provider of this document and their respective affiliates ("Provider"). This document may be used only for internal purposes by the intended recipient or as expressly authorized by the Provider. All other rights reserved.

Any and all warranties express or implied regarding this document are disclaimed to the extent allowed by law.