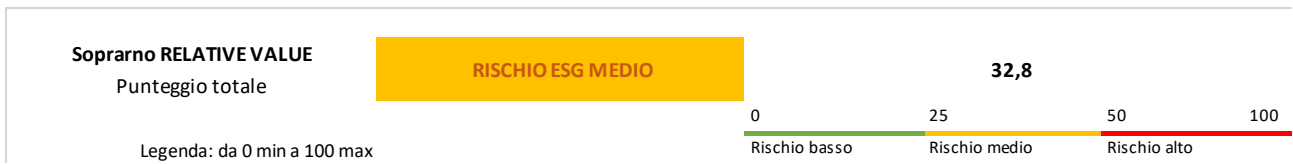


REPORTING AL 30/06/2022 DI SOPRARNO RELATIVE VALUE: RISCHIO ESG MEDIO



ANALISI DI PORTAFOGLIO

Dal monitoraggio mensile del rischio al 30/06/2022, il fondo Soprarno RELATIVE VALUE risulta avere un RISCHIO ESG MEDIO, calcolato sulla media del rischio ESG dei titoli sottostanti negli ultimi 2 anni. Lo 0% del NAV è costituito da Obbligazionario Paese, il 97,0% del NAV del fondo è costituito da titoli azionari di 100 emittenti, l'1,5% da opzioni e il restante 1,5% è costituito da liquidità (vedi Tab. 1).

RELATIVE VALUE	Nr. Emittenti	NAV %
Obbligazionario Paese*	0	0,0%
Azionario	100	97,0%
Altro**	1	1,5%
Liquidità (Debito)	-	1,5%
Totale	101	100,0%

*

**Include opzioni

Tab. 1

L'Obbligazionario Paese che avrebbe un RISCHIO ESG MEDIO è pari a 0. L'azionario ha un RISCHIO ESG MEDIO. L'86% dei titoli azionari ha avuto un RISCHIO ESG MEDIO-ALTO negli ultimi 2 anni e il 52% ha attualmente un RISCHIO ESG MEDIO-ALTO. Su totali 100 emittenti azionari investiti dal fondo, 27 hanno avuto un RISCHIO ESG ALTO negli ultimi 2 anni e di questi 9 hanno attualmente un RISCHIO ESG ALTO (vedi Tab. 2).

SCOMPOSIZIONE PER CLASSE DI RISCHIO ESG DEL PORTAFOGLIO AZIONARIO

Rischio ESG	Nr. Emittenti Rischio ESG	Nr. Emittenti Max Rischio ESG	NAV % Rischio ESG	NAV % Max Rischio ESG
Rischio alto	9	27	14,3%	32,8%
Rischio medio	33	49	36,2%	50,4%
Rischio basso	58	24	46,4%	13,8%
Totale	100	100	97,0%	97,0%

Tab. 2