



**Portafoglio Tematico Sri
giugno 2020**

Portafoglio Tematico Sri

1. Struttura del portafoglio
2. Il portafoglio Tematico Sri ottimale
3. Il sottostante
4. Analisi del rendimento
5. Confronto con il benchmark
6. Metodologia

Portafoglio Tematico Sri: struttura

COSTRUZIONE DEL PORTAFOGLIO

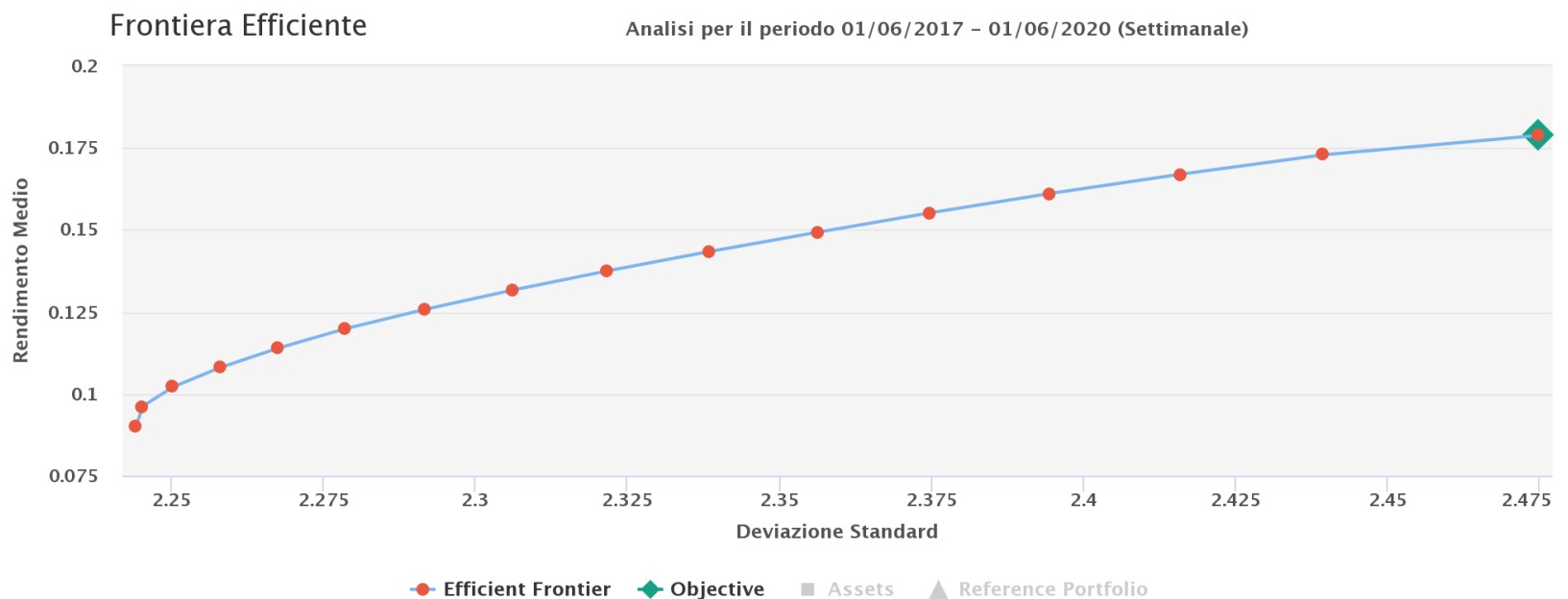
I fondi sono stati selezionati analizzando le categoria dei fondi Sri Tematici, composta da fondi azionari socialmente responsabili focalizzati su temi specifici, quali a titolo esemplificativo il cambiamento climatico, l'ambiente, l'ecologia, l'acqua, le energie rinnovabili, il capitale umano, etc.

Per ogni categoria sono stati individuati tramite un approccio quantitativo i fondi con uno Score esg elaborato da Msci almeno pari a 7

Portafoglio Tematico Sri: il portafoglio ottimale

Sulla piattaforma di analisi [atlante.sri](https://atlante.sri.it), grazie al tool della frontiera efficiente, è possibile individuare un portafoglio che ottimizza il risultato su un determinato orizzonte temporale (01-06-2017 → 01-06-2020). Nel grafico è individuato dal punto evidenziato in verde.

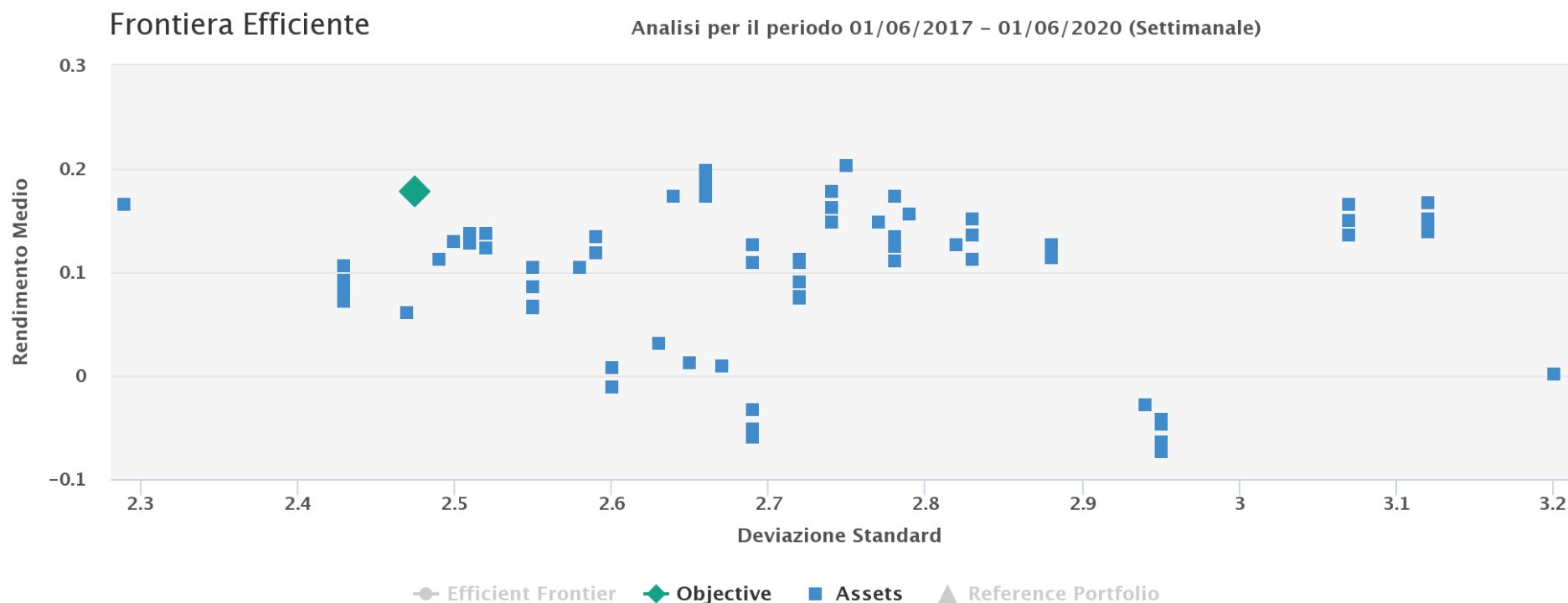
Ciascun fondo all'interno del portafoglio ha un peso non superiore al 30%



Longboat Analytics

Portafoglio Tematico Sri: il portafoglio ottimale

Nel grafico sottostante è riportato il rapporto rischio/rendimento del portafoglio Tematico Sri ottimale (in verde) rispetto a tutti i fondi individuati nella selezione iniziale.



Longboat Analytics

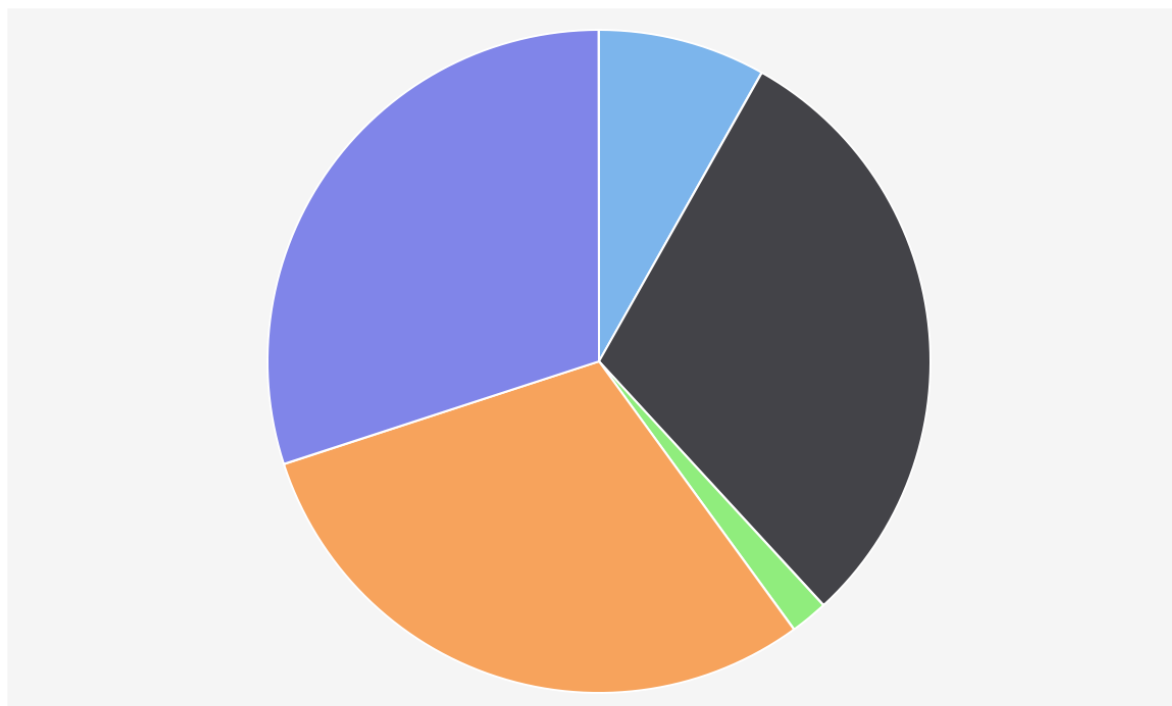
Portafoglio Tematico Sri: il sottostante

Fondo	Allocation (%)	Categoria	Società di gestione
Mirova Europe Environmental Equity	1,83%	Fondi SRI Tematici	NATIXIS IM
Schroder ISF Global Climate Change Equity	30,00%	Fondi SRI Tematici	SCHRODERS
Nordea 1 Global Climate and Environment	30,00%	Fondi SRI Tematici	NORDEA AM
IFP Global Age	30,00%	Fondi SRI Tematici	IFP
BlackRock BGF Sustainable Energy	8,17%	Fondi SRI Tematici	BLACKROCK

Benchmark	Allocation (%)	Categoria
Msci World Index	100,00%	Global Equity

Portafoglio Tematico Sri: il sottostante

% FONDI SOTTOSTANTI IL PORTAFOGLIO OTTIMALE



Longboat Analytics

- ET-BGF Sustainable Energy USD Acc X2 8.17%
- ET-IFP Global Age Acc EUR 30.00%
- ET-Natixis Mirova Europe Environmental Equity EUR Acc I 1.83%
- ET-Nordea 1 Global Climate and Environment USD Acc BI 30.00%
- ET-Schroder ISF Global Climate Change Equity EUR Acc C 30.00%

Portafoglio Tematico Sri: rendimento a 1 anno

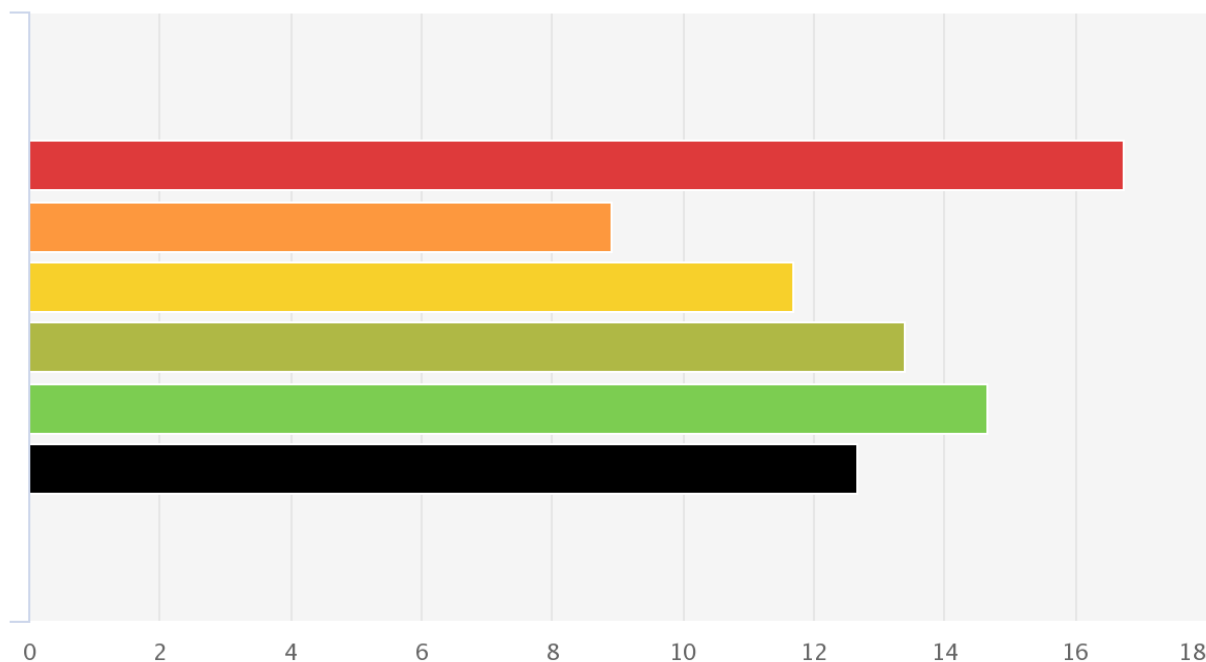
Dal 01/06/2019 al 01/06/2020



- ET-BGF Sustainable Energy USD
Acc X2 16.75%
- ET-IFP Global Age Acc EUR 8.89%
- ET-Natixis Mirova Europe Environmental
Equity EUR Acc I 11.67%
- ET-Nordea 1 Global Climate
and Environment USD Acc
BI 13.38%
- ET-Schroder ISF Global Climate
Change Equity EUR Acc
C 14.06%
- Port. Tematico SRI_06 2020 12.49%

Portafoglio Tematico Sri: rendimento a 1 anno

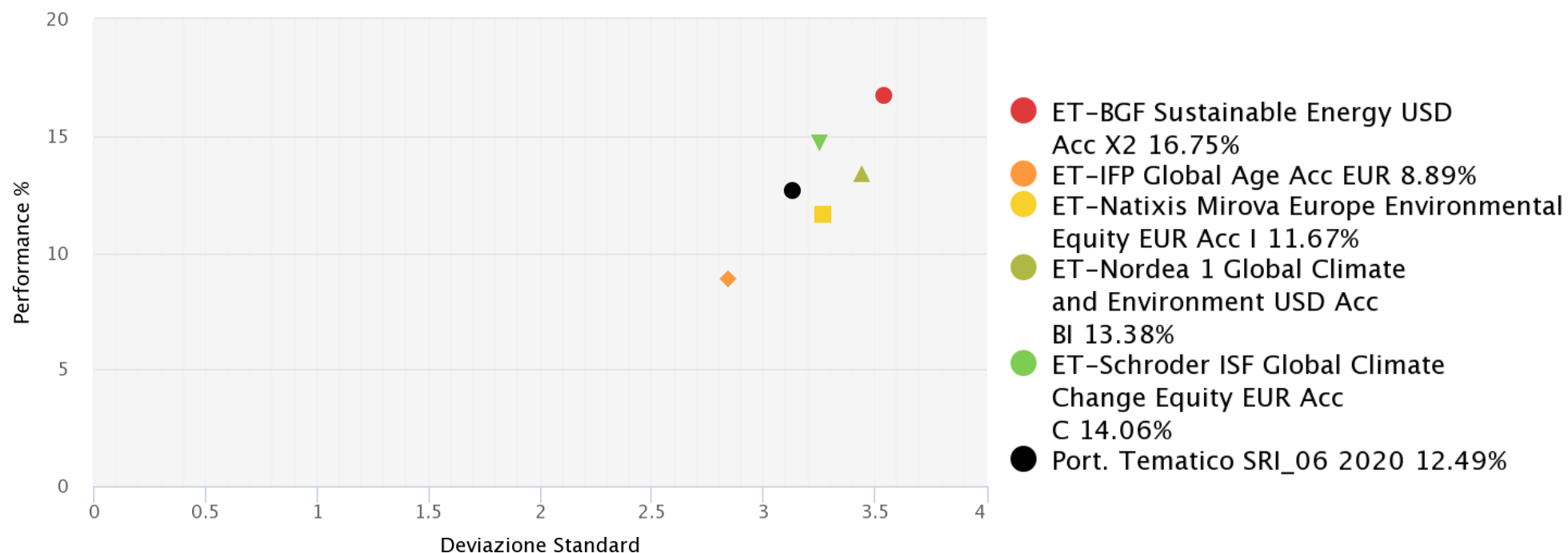
Dal 01/06/2019 al 01/06/2020



- ET-BGF Sustainable Energy USD Acc X2 16.75%
- ET-IFP Global Age Acc EUR 8.89%
- ET-Natixis Mirova Europe Environmental Equity EUR Acc I 11.67%
- ET-Nordea 1 Global Climate and Environment USD Acc BI 13.38%
- ET-Schroder ISF Global Climate Change Equity EUR Acc C 14.06%
- Port. Tematico SRI_06 2020 12.49%

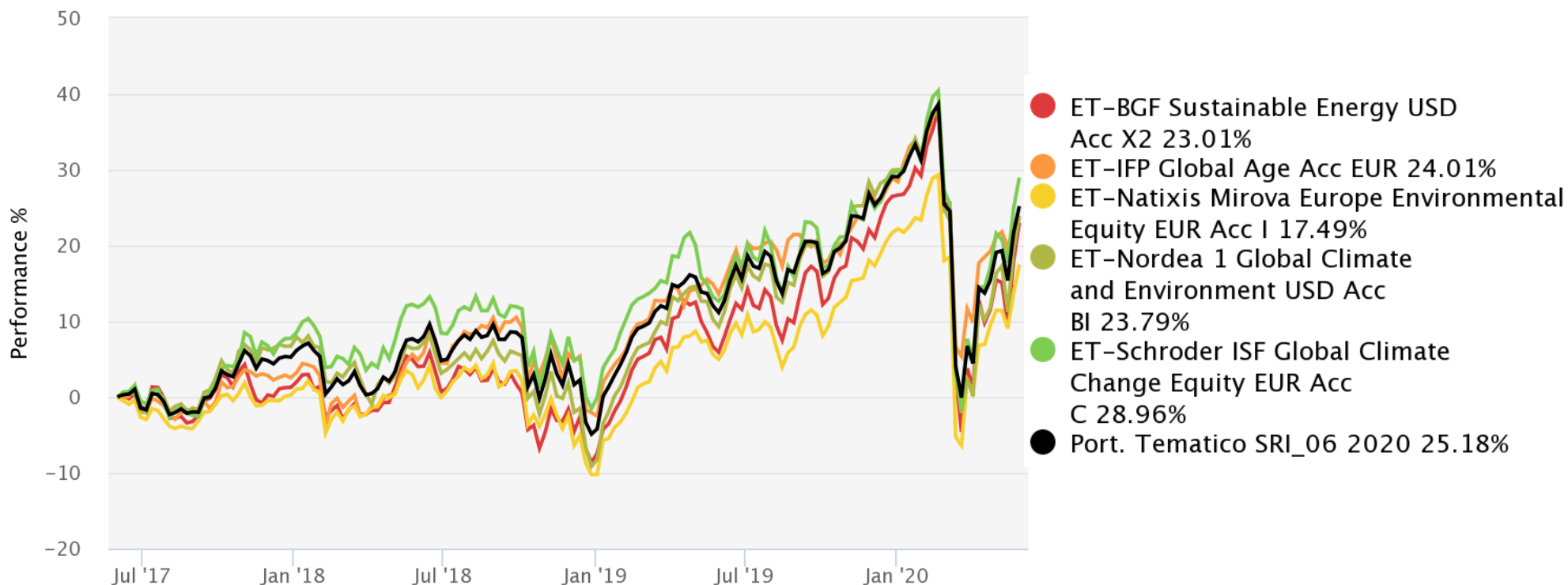
Portafoglio Tematico Sri: rischio/rend a 1 anno

Dal 01/06/2019 al 01/06/2020



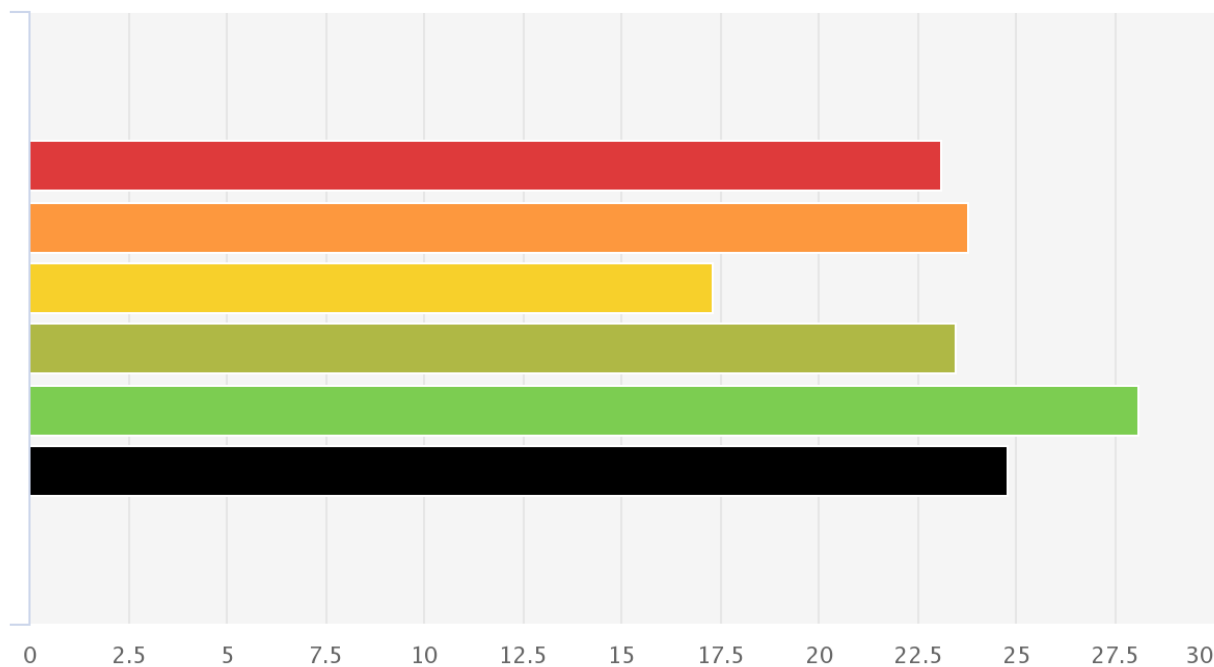
Portafoglio Tematico Sri: rendimento a 3 anni

Dal 01/06/2017 al 01/06/2020



Portafoglio Tematico Sri: rendimento a 3 anni

Dal 01/06/2017 al 01/06/2020

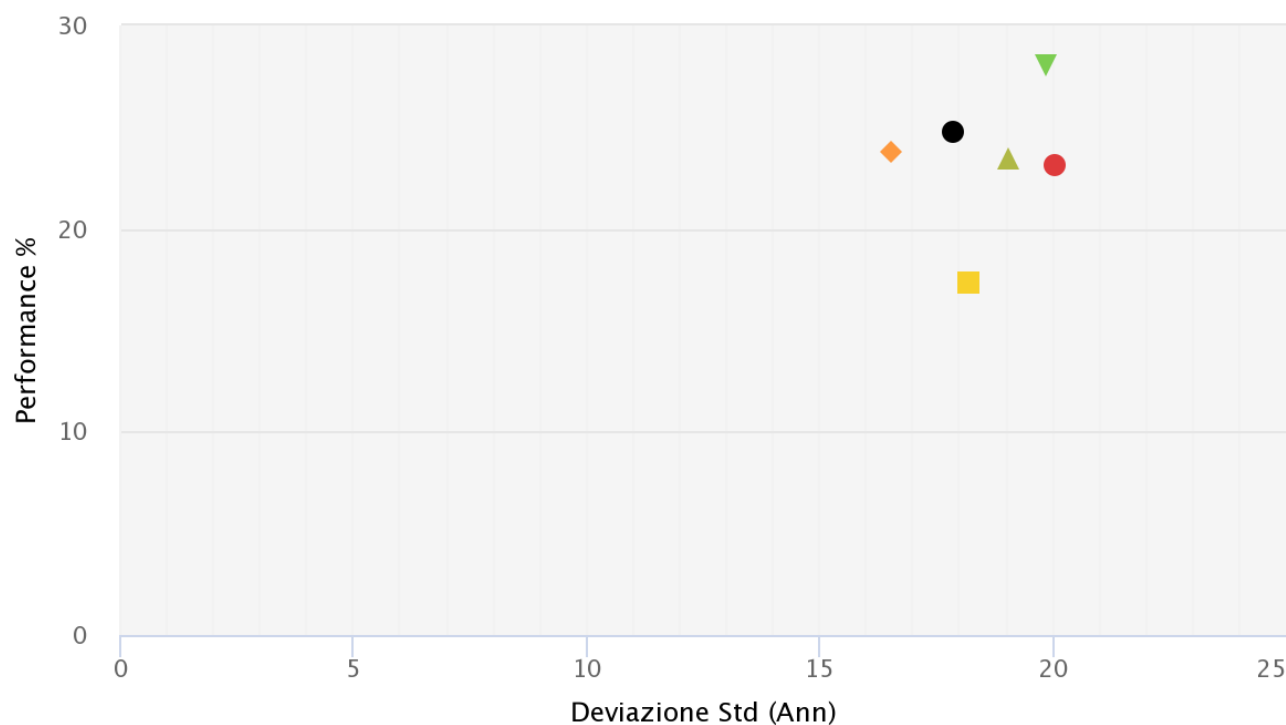


- ET-BGF Sustainable Energy USD Acc X2 23.01%
- ET-IFP Global Age Acc EUR 24.01%
- ET-Natixis Mirova Europe Environmental Equity EUR Acc I 17.49%
- ET-Nordea 1 Global Climate and Environment USD Acc BI 23.79%
- ET-Schroder ISF Global Climate Change Equity EUR Acc C 28.96%
- Port. Tematico SRI_06 2020 25.18%

Portafoglio Tematico Sri: rischio/rendimento a 3 anni



Dal 01/06/2017 al 01/06/2020



- ET-BGF Sustainable Energy USD Acc X2 23.01%
- ET-IFP Global Age Acc EUR 24.01%
- ET-Natixis Mirova Europe Environmental Equity EUR Acc I 17.49%
- ET-Nordea 1 Global Climate and Environment USD Acc BI 23.79%
- ET-Schroder ISF Global Climate Change Equity EUR Acc C 28.96%
- Port. Tematico SRI_06 2020 25.18%

Portafoglio Tematico Sri vs il benchmark a 1 anno

Dal 01/06/2019 al 01/06/2020

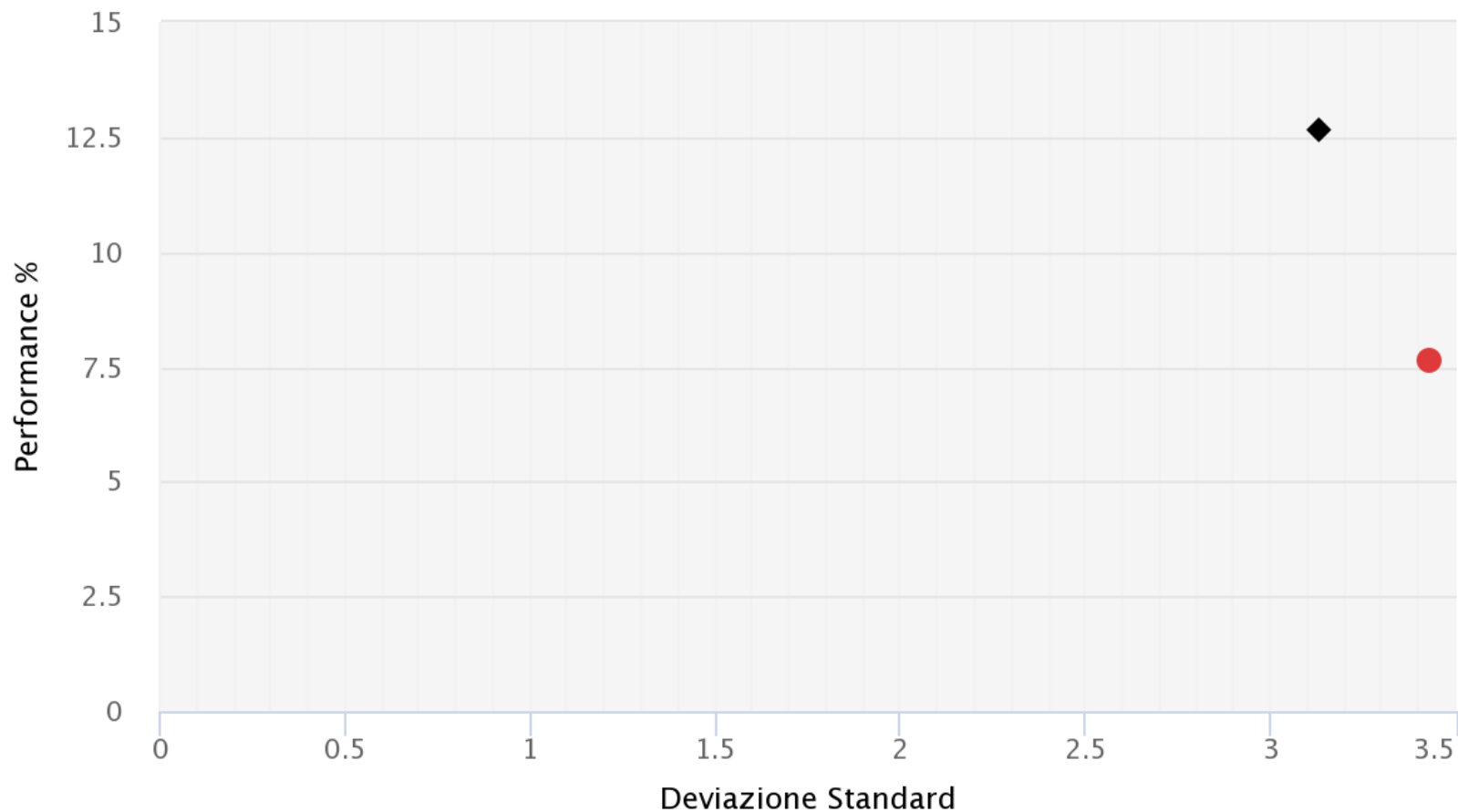


Longboat Analytics

- MSCI The World Index USD (Net TR) 6.99%
- Port. Tematico SRI_06 2020 12.49%

Portafoglio Tematico Sri vs il benchmark a 1 anno

Dal 01/06/2019 al 01/06/2020



Longboat Analytics

- MSCI The World Index USD (Net TR)
- ◆ Port. Tematico SRI_06 2020

Portafoglio Tematico Sri vs il benchmark a 3 anni

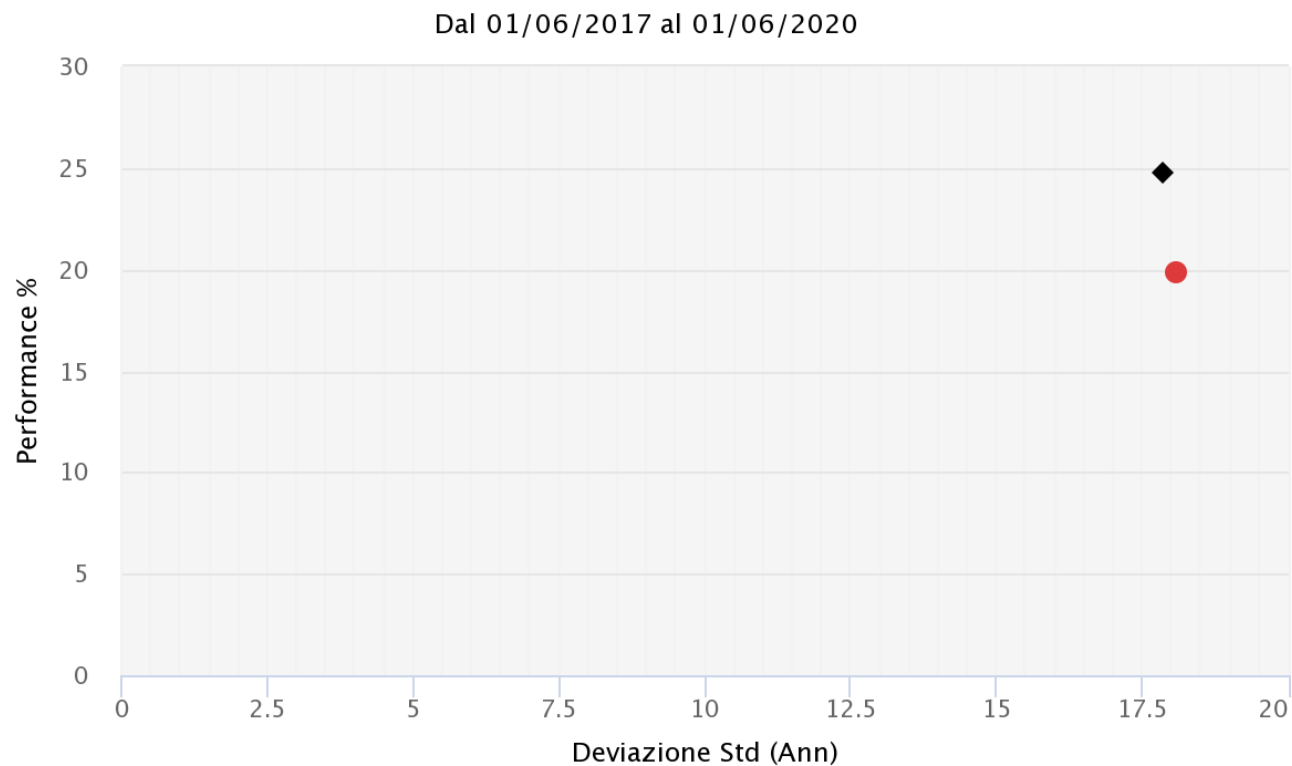
Dal 01/06/2017 al 01/06/2020



Longboat Analytics

- MSCI The World Index USD (Net TR) 19.91%
- Port. Tematico SRI_06 2020 25.18%

Portafoglio Tematico Sri vs il benchmark a 3 anni

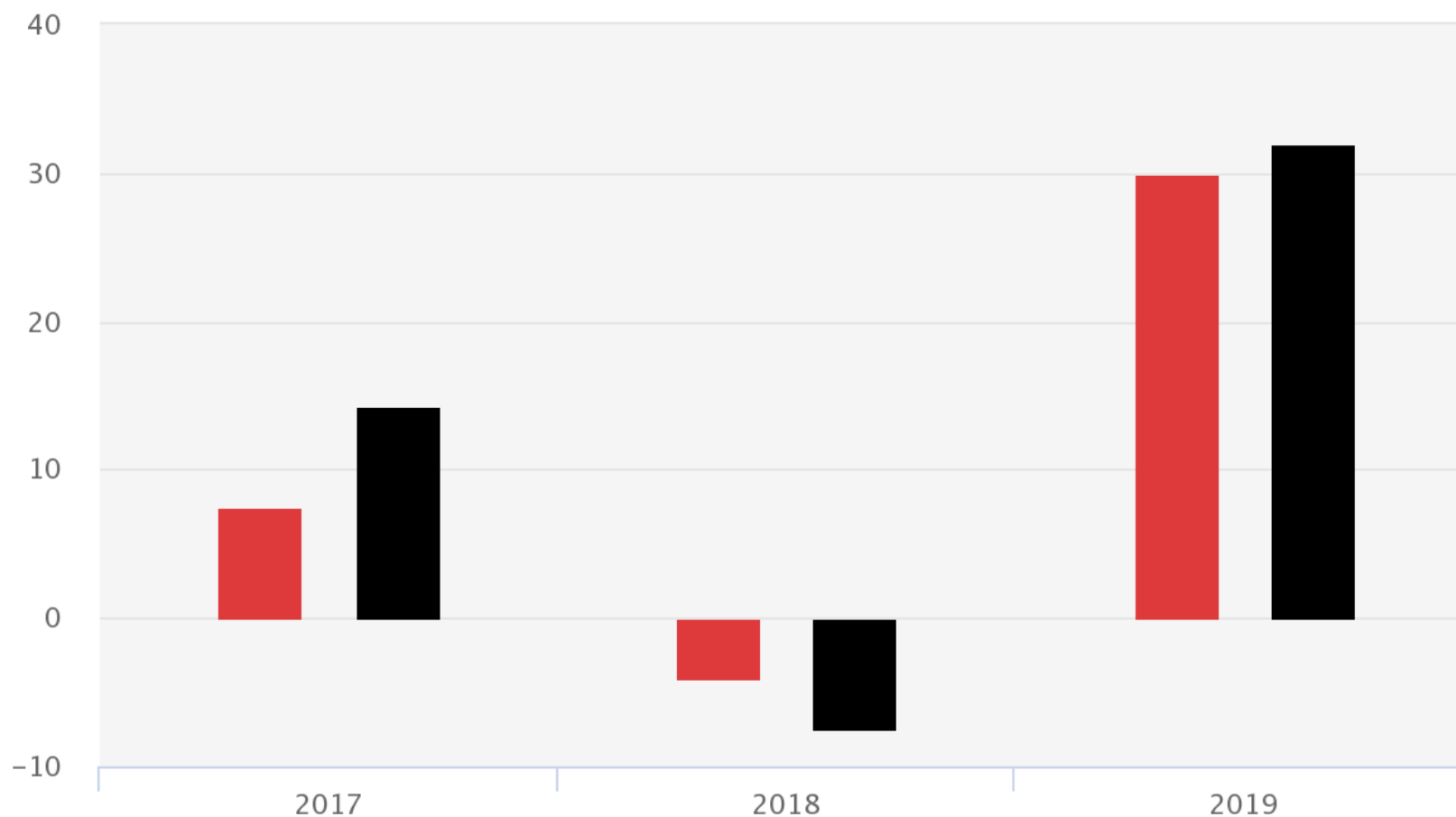


Longboat Analytics

- MSCI The World Index USD (Net TR)
- ◆ Port. Tematico SRI_06 2020

Portafoglio Tematico Sri vs il benchmark

Dal 01/01/2017 al 31/12/2019



Longboat Analytics

- MSCI The World Index USD (Net TR)
- Port. Tematico SRI_06 2020

Metodologia

- L'Atlante Sri include:
 - i fondi che nel nome indicano esplicitamente l'impostazione Sri
 - i fondi con esplicito mandato Sri presente sul kiid
 - i fondi il cui tema è strettamente legato ad almeno uno dei fattori ESG

- La categorizzazione dei fondi Sri è a cura di ETicaNews: per visualizzare i panieri dei fondi Sri di ETicaNews vai a www.eticanews.it/etpro/et-investi-sri/osservatorio-sri

- Le informazioni contenute nel presente documento non costituiscono consulenza d'investimento o raccomandazione d'investimento

- Le analisi e le classifiche complete, nonché eventuali elaborazioni specifiche, possono essere richieste all'ufficio studi ETicaNews