

Analisi di Portafoglio ESG, CLIMATE e SDGs al 31.12.2022

La presente Analisi ESG, CLIMATE e SDGs di Portafoglio propone una fotografia istantanea al 31 dicembre 2022 del livello di sostenibilità degli investimenti mobiliari del Fondo Pensione Cometa.

L'attività di screening è stata condotta attraverso l'ausilio del database internazionale di Moody's Analytics, che contiene informazioni sulle performance ambientali e sociali di un vasto numero di emittenti, corporate e governativi, e che consente di calcolare uno score ESG sulla base di criteri predefiniti, nonché la Carbon Footprint (CF) e l'Energy Transition Strategy score (ETS). Inoltre, il database permette di determinare l'allineamento di ogni società ad alcuni selezionati SDGs.

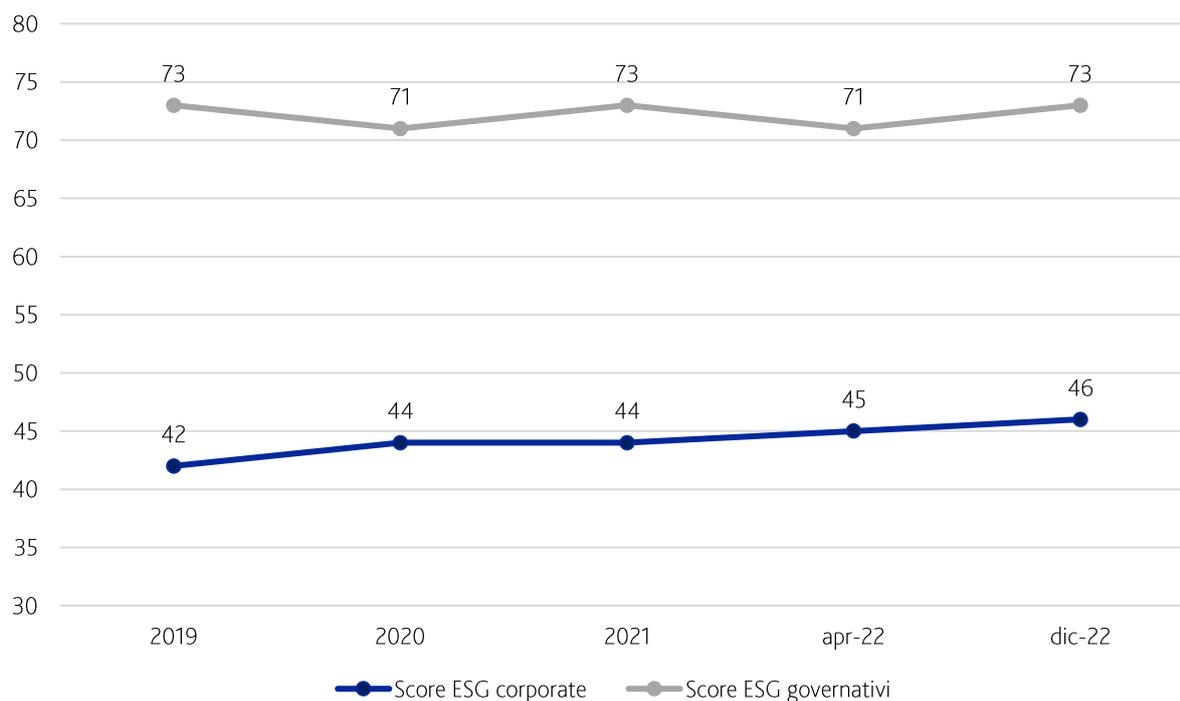
La valutazione ha riguardato emittenti corporate, emittenti governativi, organismi sovranazionali e OICR.

Nelle tabelle seguenti vengono riportati i risultati consolidati (investimenti diretti e investimenti in OICR) per gli emittenti corporate e per gli emittenti governativi.

31.12.2022 - Corporate	Score ESG	CF (tCO2eq)	ETS
Portafoglio FP	46/100	4.854.815	49/100
Benchmark - ETF iShares MSCI World	42/100	5.970.529	45/100

31.12.2022 - Paesi	Score ESG
Portafoglio FP	73/100
Benchmark - XTrackers Government bond	64/100

Trend Score ESG



Analisi CLIMATE: CF ed ETS investimenti corporate CC

Tipologia di investimento	CARBON FOOTPRINT (tCO ₂ eq)			ENERGY TRANSITION SCORE		
	12.2022	04.2022	08.2021	12.2022	04.2022	08.2021
Investimenti diretti	4.796.962	4.602.252	4.875.981	50	47	46
Investimenti in OICR/ETF	5.481.085	5.627.679	-	40	42	-
TOTALE FONDO	4.854.815	4.713.840	-	49	46	-
<i>Benchmark</i>	5.970.529	4.565.955	4.773.771	45	43	42

Portafoglio/Gestori	Asset € corporate	CARBON FOOTPRINT (tCO ₂ eq)		ENERGY TRANSITION SCORE	
	12.2022	12.2022	04.2022	12.2022	04.2022
CRESCITA ALLIANZ	-	-	5.310.927	-	50
CRESCITA BLACKROCK	324.581.110	4.916.184	3.921.048	49	45
CRESCITA EURIZON	352.662.304	4.518.128	-	48	-
MONETARIO ALLIANZ	156.359.298	3.340.606	4.721.759	54	45
MONETARIO EURIZON	142.807.465	3.649.007	4.250.053	56	52
MONETARIO GROUPAMA	-	-	1.763.984	-	44
REDDITO ALLIANZ	772.016.374	5.423.555	4.997.807	49	50
REDDITO AMUNDI	721.176.701	6.059.203	-	52	-
REDDITO AXA	1.147.379.299	3.396.470	-	50	-
REDDITO BLACKROCK	811.294.917	4.618.867	3.767.545	46	44
REDDITO EURIZON	334.299.854	4.389.187	-	49	-
REDDITO CANDRIAM	-	-	3.829.925	-	50
REDDITO CREDIT SUISSE	-	-	4.793.063	-	46
REDDITO SSGA	-	-	4.885.628	-	41
SICUREZZA 2020 GENERALI	414.974.303	6.915.395	6.616.640	56	54
TFR SILENTE GENERALI	96.882.104	5.476.692	5.689.040	58	56
Investimenti diretti	5.274.433.728	4.796.962	4.602.252	50	47
Investimenti in OICR/ETF	487.244.552	5.481.085	7.552.954	40	42
TOTALE FONDO	5.761.678.280	4.854.815	4.923.350	49	46

Analisi SDGs: investimenti diretti corporate

Lo screening degli investimenti diretti corporate rispetto agli Obiettivi di Sviluppo Sostenibile delle Nazioni Unite (UN SDGs) è determinato da due componenti:

- misurazione del contributo netto (*net contribution*) a ciascun SDGs, in termini di attività, prodotti o servizi della società che contribuiscono positivamente o negativamente;
- misurazione del comportamento netto (*net behavior*) verso ciascun SDGs, in termini di modalità della gestione del business e di eventuali controversie relative a uno specifico SDG.

Per il dettaglio della valutazione si rimanda alla metodologia in calce alla presente analisi.

Per ogni tematica considerata rilevante da Cometa sono stati associati i rispettivi SDGs.

Nella tabella viene riportata la percentuale di asset, sul totale degli investimenti diretti corporate, investiti in società che contribuiscono positivamente (*highly positive* e *positive*) e hanno un comportamento favorevole (*highly favourable* e *favourable*) nei confronti di ciascun SDG individuato.

Non ci sono singoli SDG direttamente associabili alla corporate governance, in quanto tale tematica è trasversale a tutti gli obiettivi dello sviluppo sostenibile.

Tematiche rilevanti per Cometa / SDG		% Asset investiti (highly positive + positive + highly favourable + favourable)	
		Cometa	Benchmark - iShares MSCI World UCITS
Salute e sicurezza sul lavoro			
	Salute e benessere	11,3%	14,5%
	Lavoro dignitoso e crescita economica	20,7%	15,6%
Cambiamento climatico			
	Energia pulita e accessibile	9,9%	10,2%
	Lotta contro il cambiamento climatico	20,7%	13%
Biodiversità			
	Vita sott'acqua	1,9%	1%
	Vita sulla terra	3,1%	2,2%