

COREPENSION OBBLIGAZIONARIO MISTO 25% ESG

REPORT
MENSILE

28/02/2023

■ Categoria Covip: Obbligazionario Misto

Informazioni chiave (Fonte : Amundi)

Valore quota (NAV) : 4,809 (EUR)

Data di valorizzazione : 28/02/2023

Patrimonio in gestione : 63,58 (milioni EUR)

Benchmark :

15% MSCI WORLD EX EMU EURO HEDGED NETTO
ITALIAN PENSION FUNDS + 10% MSCI EMU NETTO
ITALIAN PENSION FUNDS + 65% JPM GBI GLOBAL
TRADED INDEX HEDGED EURO NETTO ITALIAN
PENSION FUNDS + 10% BLOOMBERG EURO
TREASURY 0-6 MONTHS NETTO 12.5 PC

Valuta di riferimento della classe : EUR

Frequenza di calcolo della quota : Quindicinale

Obiettivo di investimento

Il Comparto ha come **obiettivo realizzare in un orizzonte temporale tendenzialmente di medio periodo una crescita contenuta del capitale**, per rispondere alle esigenze di un soggetto che ha davanti a sé ancora alcuni anni di attività. Il comparto è caratterizzato da un grado di rischio medio.

Le disponibilità del Comparto, tenuto conto anche dell'esposizione realizzata tramite derivati, sono investite nel rispetto dei seguenti limiti:

Strumenti finanziari di natura monetaria ed obbligazionaria (possibili ampie diversificazioni anche geografiche): massimo 85% del patrimonio del Comparto;

Strumenti finanziari di natura azionaria (possibili ampie diversificazioni anche geografiche): almeno il 15% del patrimonio del Comparto e non possono superare il limite massimo del 30% dello stesso;

Strumenti finanziari collegati al rendimento di materie prime: massimo 5% del patrimonio del Comparto.

Il Comparto può utilizzare OICR fino al 100% del suo patrimonio.

Ulteriori informazioni (Fonte : Amundi)

Società di gestione : Amundi SGR S.p.A

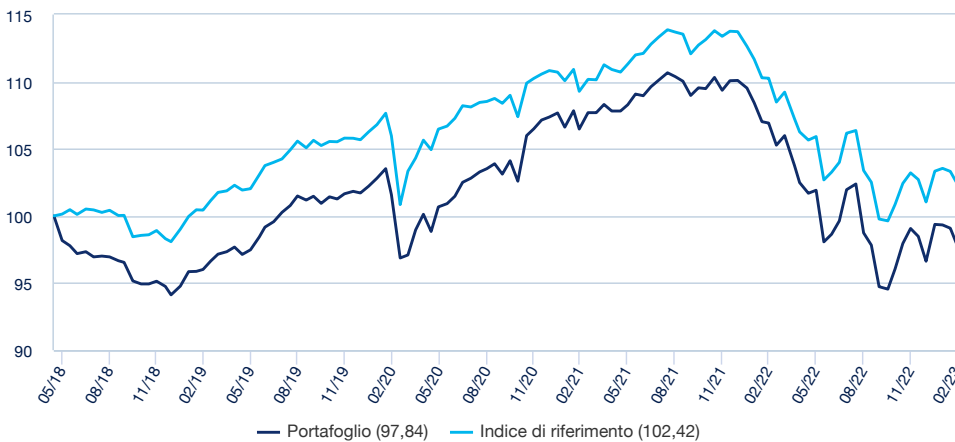
Banca depositaria :

SOCIETE GENERALE SECURITIES SERVICES S.P.A.

Agente amministrativo : PREVINET

Performance (Fonte : Fund Admin) - I rendimenti passati non sono indicativi di quelli futuri

Evoluzione della performance (base 100) * dal 15/05/2018 al 28/02/2023 (Fonte : Fund Admin)



Performance * (Fonte : Fund Admin)

	Da inizio anno	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	Da inizio gestione
A partire dal	30/12/2022	31/01/2023	30/11/2022	28/02/2022	28/02/2020	-	15/05/2018
Portafoglio	1,26%	-1,50%	-1,23%	-8,49%	-3,69%	-	-2,16%
Benchmark	1,37%	-1,08%	-0,76%	-7,11%	-3,34%	-	2,42%

Performance annuale * (Fonte : Fund Admin)

	2022	2021	2020	2019	2018
Portafoglio	-12,23%	2,54%	5,56%	8,06%	-
Benchmark	-11,15%	2,62%	4,88%	7,74%	-

* Le performance sono al netto degli oneri fiscali e al netto di costi/commissioni.
Le performance riportate si riferiscono a periodi completi di 12 mesi per ciascun anno civile. Le performance passate non sono indicative delle performance future. Il valore degli investimenti può variare al rialzo o al ribasso in base all'evoluzione dei mercati.

Caratteristiche principali (Fonte : Amundi)

Categoria giuridica : **Fondo Pensione Aperto**

Prima data di NAV : **30/04/2018**

Orizzonte d'investimento minimo consigliato : **7 anni**

Spese (Fonte : Amundi)

Costo amministrativo annuo : **20 Euro**

Adesione : **non prevista**

Riscatto/Trasferimento : **10 Euro**

Anticipazione : **10 Euro**

Riallocazione (switch) della posizione individuale : **5 Euro**

Riallocazione (switch) del flusso contributivo : **5 Euro**

Commissioni (Fonte : Amundi)

Commissioni di gestione massima applicabile : **0,80%**

Commissioni legate al rendimento : **No**

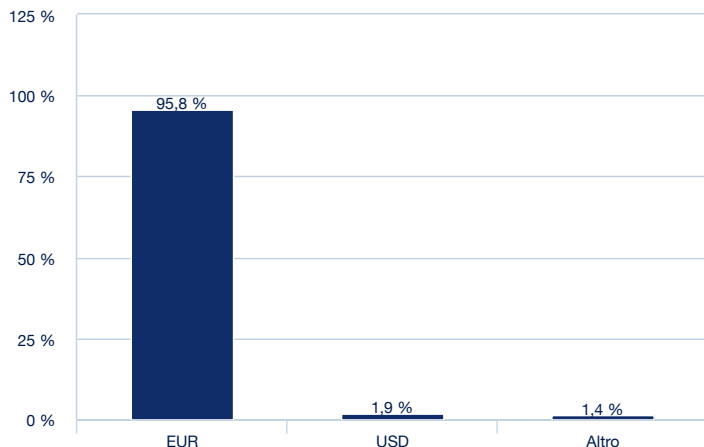
Composizione del portafoglio (Fonte : Amundi)

	Esposizione Lorda	Esposizione Netta
Azionario	23,63%	23,63%
Titoli	23,63%	23,63%
Obbligazionario/Monetario	69,59%	69,59%
Titoli a medio/lungo termine	62,33%	62,33%
Titoli a breve termine	7,26%	7,26%
Volatilità	-	-
Liquidità	6,78%	6,74%
Altro	0,00%	0,00%
Totale	100%	99,96%

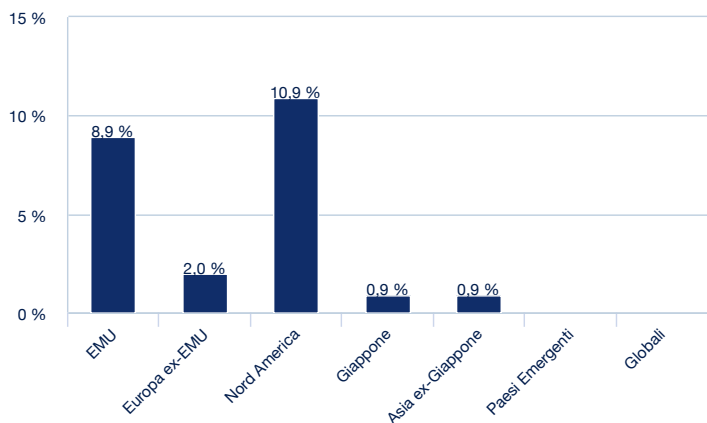
Esposizione Lorda % : peso non comprensivo dell'esposizione in strumenti derivati eventualmente presenti.

Esposizione Netta % : peso comprensivo dell'esposizione su strumenti derivati. Il totale dell'esposizione del portafoglio potrebbe differire da 100% in presenza di derivati.

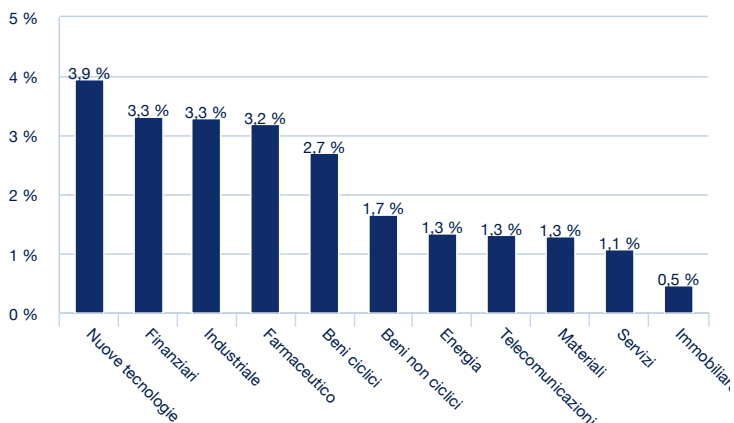
Ripartizione del portafoglio per valuta (Fonte : Amundi)



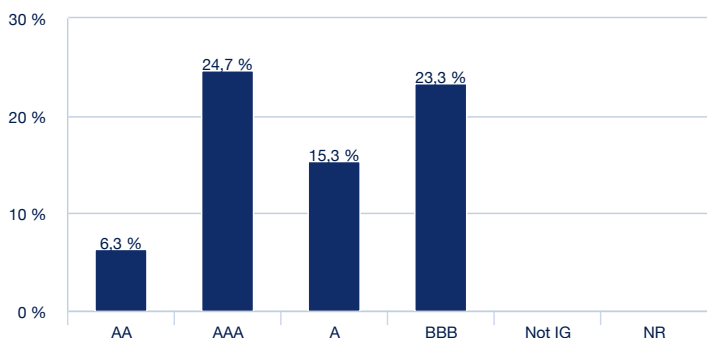
Componente Azionaria – Ripartizione per Area Geografica (inclusi i derivati) (Fonte : Amundi)



Componente Azionaria – Ripartizione per Settore (inclusi i derivati) (Fonte : Amundi)



Componente Obbligazionaria – Ripartizione titoli per rating (Fonte : Amundi)



Il rating attribuito a ciascun titolo è il più alto (Max Rating) tra quelli disponibili delle principali agenzie di rating (S&P, Moody's, Fitch).

Modified duration in anni (inclusi i derivati) (Fonte : Amundi)

Fondo 4,29
La Modified Duration (in punti) rappresenta la variazione percentuale del prezzo a fronte di un'evoluzione dell'1% del tasso di riferimento.

Principali strumenti in portafoglio (Fonte : Amundi)

Titolo	Portafoglio	
US912828Z948	US TSY 1.5% 02/30	5,10%
US9128285M81	US TSY 3.125% 11/28	2,87%
US91282CBH34	US TSY 0.375% 01/26	2,67%
US9128283F58	US TSY 2.25% 11/27	2,61%
US912810RS96	US TSY 2.5% 5/46	2,59%
Totale	-	15,85%

Terminologia ESG

Investimenti Socialmente Responsabili (ISR)

L'Investimento Socialmente Responsabile (ISR) è la pratica secondo la quale considerazioni di ordine ambientale, sociale o etico vengono introdotte nel processo decisionale di scelta o di mantenimento di un investimento, nonché nell'esercizio dei diritti connessi alla proprietà dei titoli.

L'ISR, dunque, introduce nel sistema di valutazione dei dati finanziari l'attenzione ad elementi non finanziari, fino a poco tempo fa non considerati nelle analisi economico-finanziarie tradizionali. Questa integrazione extra-finanziaria è comunemente conosciuta con l'acronimo ESG.

Criteri ESG

Attraverso i criteri ESG Amundi prende in considerazione gli aspetti ambientali, sociali e di governance nei processi decisionali di investimento, al fine di misurare le prestazioni in termini di sostenibilità degli emittenti pubblici e privati.

"E" è l'abbreviazione di Environment, ovvero fattori ambientali quali i livelli di consumo di energia, gas e acqua, la gestione dei rifiuti etc.

"S" è l'abbreviazione di Social, ovvero fattori sociali in termini di diritti umani, salute, qualità delle condizioni lavorative etc.

"G" è l'abbreviazione di Governance, ovvero fattori quali l'indipendenza del consiglio di amministrazione, protezione dei diritti degli azionisti etc.

ISR secondo Amundi

Scala di valutazione

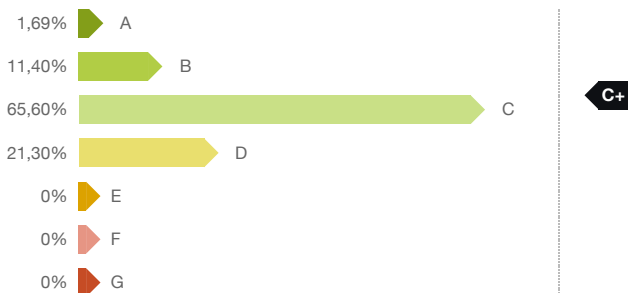


Scala di valutazione – Regole

Punteggio medio ESG del portafoglio del Fondo e confronto con il punteggio ESG medio del suo universo di investimento

Amundi esamina il comportamento delle imprese in una triplice prospettiva: ambientale, sociale e di governance (ESG). Il punteggio medio ESG del Fondo è calcolato come la media ponderata sull'attivo dei punteggi ESG degli emittenti degli strumenti finanziari in portafoglio.

Del Portafoglio²



Valutazione in base ai criteri ESG (Fonte : Amundi)

Environment	C
Sociale	C+
Governance	C
Rating Globale	C+

Copertura della Analisi ESG² (Fonte : Amundi)

Numero di emittenti	266
% del portafoglio	100%

¹ in caso del deterioramento della notazione di un'emittente in E, F o G, il gestore dispone di un termine di 3 mesi per vendere il titolo. Una tolleranza è autorizzata per i fondi buy and hold

Rating ESG - Migliori 5

	Emittente	Peso % (PTF)
INTERNATIONAL BK RECONSTR DVPT	INTERNATIONAL BK RECONSTR DVPT	1,39%
EDP FINANCE BV	EDP FINANCE BV	0,15%
CNH INDUSTRIAL NV	CNH INDUSTRIAL NV	0,10%
ORSTED AS	ORSTED AS	0,10%
VALEO	VALEO	0,09%

Rating ESG - Peggiori 5

	Emittente	Peso % (PTF)
NEXTERA ENERGY INC	NEXTERA ENERGY INC	0,25%
JPMORGAN CHASE & CO	JPMORGAN CHASE & CO	0,94%
SWEDBANK AB	SWEDBANK AB	0,30%
COGA COLA CO/THE	COGA COLA CO/THE	0,17%
ROCKWELL AUTOMATION INC	ROCKWELL AUTOMATION INC	0,25%

Informazioni Legali / Disclaimer

Messaggio con finalità puramente informative riguardante forme pensionistiche complementari – prima dell'adesione leggere la Parte I 'Le informazioni chiave per l'aderente' e l'Appendice 'Informativa sulla sostenibilità', della Nota informativa.
I rendimenti passati non sono indicativi di quelli futuri.

Per ulteriori informazioni consultare la documentazione informativa disponibile gratuitamente sul sito www.corepension.it, presso la sede della SGR e presso i soggetti incaricati della raccolta delle adesioni. Il presente documento non è rivolto ai cittadini o residenti negli Stati Uniti d'America o a qualsiasi "U.S. Person" così come definiti dalla "Regulation S" della Securities and Exchange Commission ai sensi dello US Securities Act del 1933.