

# COREPENSION GARANTITO ESG

REPORT  
MENSILE

28/02/2023

## ■ Categoria Covip: **Garantito**

### Informazioni chiave (Fonte : Amundi)

Valore quota (NAV) : **4,63 ( EUR )**  
Data di valorizzazione : **28/02/2023**  
Patrimonio in gestione : **71,40 ( milioni EUR )**  
Benchmark : **Nessun Benchmark**  
Valuta di riferimento della classe : **EUR**  
Frequenza di calcolo della quota : **Quindicinale**

### Obiettivo di investimento

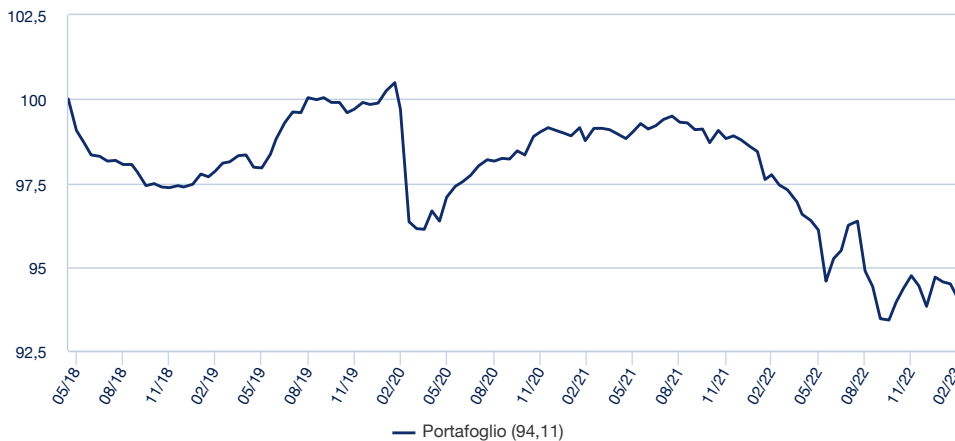
Il Comparto ha come **obiettivo realizzare con elevata probabilità rendimenti che siano almeno pari a quelli del TFR in un orizzonte temporale di breve periodo**. La presenza della garanzia consente di soddisfare le esigenze di un soggetto con una bassa propensione al rischio. Il Comparto investe, in proporzioni flessibili, in strumenti finanziari di natura monetaria, obbligazionaria e azionaria nel rispetto dei seguenti limiti:  
**Strumenti finanziari di natura monetaria ed obbligazionaria** (possibili ampie diversificazioni anche geografiche): almeno il 70% del patrimonio del Comparto e posso raggiungere il 100% dello stesso;  
**Strumenti finanziari di natura azionaria** (possibili ampie diversificazioni anche geografiche): massimo 30% del patrimonio del Comparto;  
**Strumenti finanziari collegati al rendimento di materie prime**: massimo 5% del patrimonio del Comparto.

### 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)



#### Caratteristiche principali (Fonte : Amundi)

Categoria giuridica : **Fondo Pensione Aperto**  
Prima data di NAV : **30/04/2018**  
Orizzonte d'investimento minimo consigliato : **3 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**

#### Performance \* (Fonte : Fund Admin)

A partire dal	Da inizio anno	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	Da inizio gestione
	30/12/2022	31/01/2023	30/11/2022	28/02/2022	28/02/2020	-	15/05/2018
<b>Portafoglio</b>	0,30%	-0,47%	-0,67%	-3,72%	-5,61%	-	-5,89%

#### Performance annuale \* (Fonte : Fund Admin)

	2022	2021	2020	2019	2018
<b>Portafoglio</b>	-5,02%	-0,29%	-0,77%	2,53%	-

\* 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.

#### Commissioni (Fonte : Amundi)

Commissioni di gestione massima applicabile : **0,80%**  
Commissioni legate al rendimento : **No**

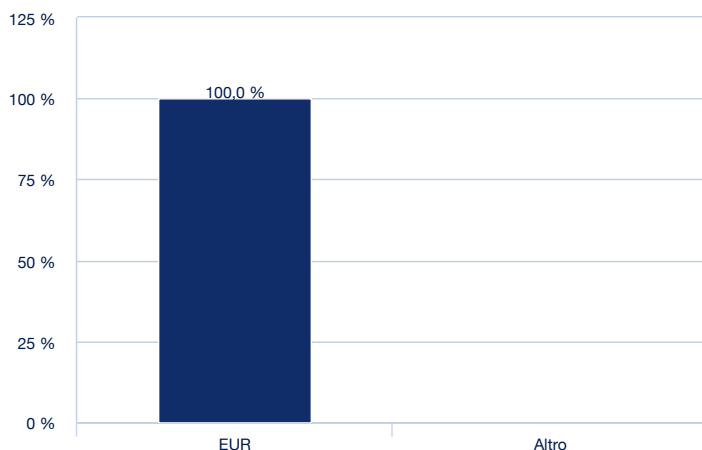
**Composizione del portafoglio (Fonte : Amundi)**

	Esposizione Lorda	Esposizione Netta
<b>Azionario</b>	3,01%	3,01%
Titoli	3,01%	3,01%
<b>Obbligazionario/Monetario</b>	84,42%	84,42%
Titoli a medio/lungo termine	61,71%	61,71%
Titoli a breve termine	22,71%	22,71%
<b>Volatilità</b>	-	-
<b>Liquidità</b>	12,56%	12,56%
<b>Altro</b>	-	-
<b>Totale</b>	100%	100%

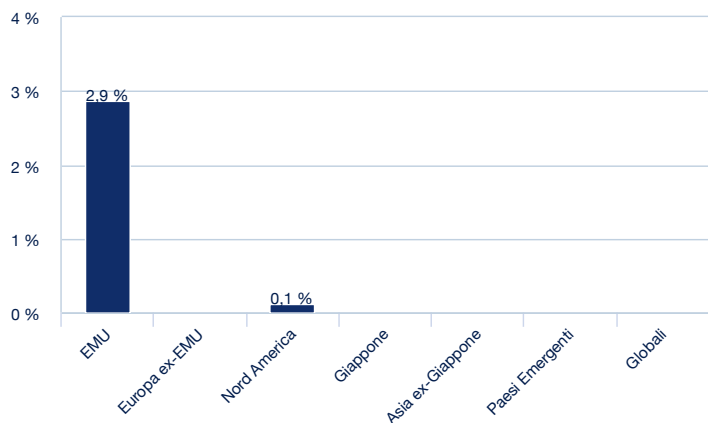
Esposizione Lorda % : peso non comprensivo dell'esposizione in strumenti derivati eventualmente presenti.

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

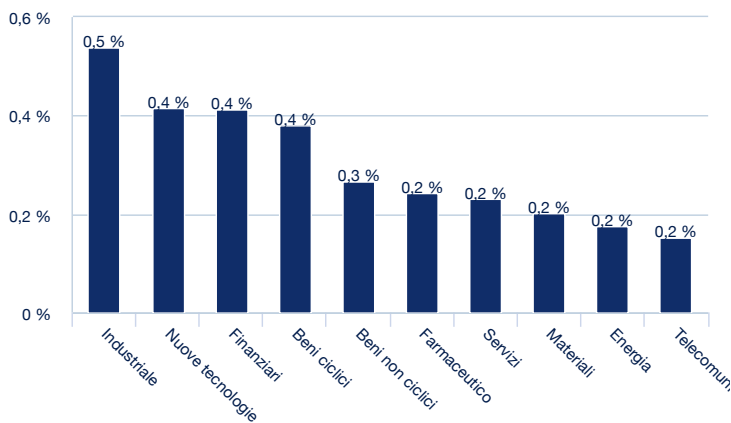
**Ripartizione del portafoglio per valuta (Fonte : Amundi)**



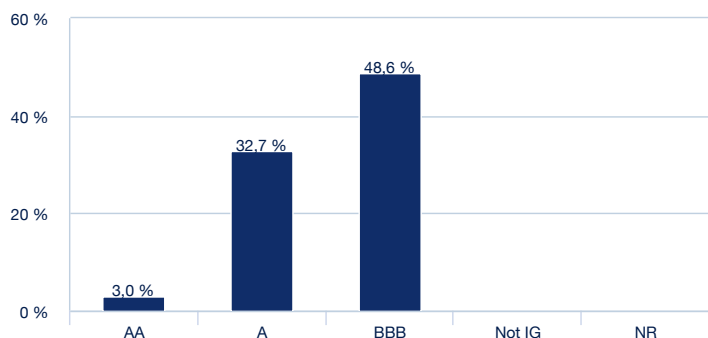
**Componente Azionaria – Ripartizione per Area Geografica (inclusi i derivati) (Fonte : Amundi)**



**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 1,89  
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
IT0005416570	BTPS 0.95% 09/27 7Y	6,22%
IT0004644735	BTPS 4.5% 03/26	5,46%
ES00000126Z1	SPAIN 1.6% 4/25	5,08%
ES00000123C7	SPAIN 5.90% 07/26	4,70%
IT0005210650	BTPS 1.25% 12/26	4,50%
<b>Totale</b>	-	<b>25,96%</b>

**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**

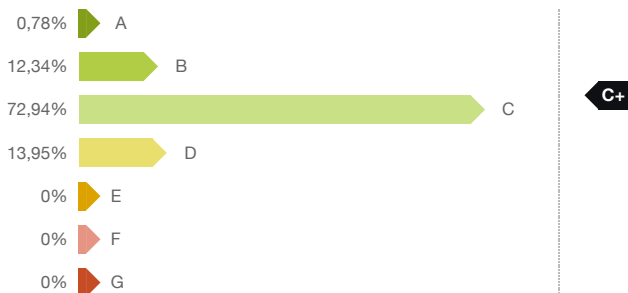
Scala di valutazione



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 Portafoglio<sup>2</sup>****Valutazione in base ai criteri ESG (Fonte : Amundi)**

Environment	C
Sociale	B-
Governance	C
Rating Globale	C+

**Copertura della Analisi ESG<sup>2</sup> (Fonte : Amundi)**

Numero di emittenti	119
% del portafoglio	100%

<sup>1</sup> 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)
ITALGAS SPA	ITALGAS SPA	1,09%
ORSTED AS	ORSTED AS	0,48%
COVIVIO	COVIVIO	0,23%
CNH INDUSTRIAL NV	CNH INDUSTRIAL NV	0,04%
VALEO	VALEO	0,03%

## Rating ESG - Peggiori 5

	Emittente	Peso % (PTF)
NTT FINANCE CORP	NTT FINANCE CORP	0,44%
INFRASTRUCTURE WIRELESS ITALI	INFRASTRUCTURE WIRELESS ITALI	0,06%
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	0,42%
THERMO FISHER SCIENTI FIN 1 BV	THERMO FISHER SCIENTI FIN 1 BV	0,95%
CHUBB INA HOLDINGS INC	CHUBB INA HOLDINGS INC	0,15%

**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](http://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.