



Fondo Pensioni del Personale del Gruppo BNL/BNP Paribas Italia

Iscritto all'Albo tenuto dalla COVIP con il n. 1143



Via degli Aldobrandeschi, 300 – 00163 Roma



+39 06 4702.1; +39 06 89480411



fp.gruppo.bnl.bnpp.it@bnlmail.com

fondopensionipersonalegruppobnlbnppit@pec.bnlmail.com



www.fondopensionibnl.it

## Nota informativa

(depositata presso la COVIP il 22 giugno 2022)

### Appendice

#### 'Informativa sulla sostenibilità'

**Il Fondo Pensioni del Gruppo BNL/BNP Paribas Italia è responsabile della completezza e veridicità dei dati e delle notizie contenuti nella presente Nota informativa.**

#### Informazioni sulle caratteristiche ambientali o sociali/investimenti sostenibili

Nell'ambito della propria politica d'investimento, pur tenendo conto dei citati profili ambientali, sociali e di governo (ESG), il Fondo Pensioni di BNL/ Gruppo BNP Paribas non promuove caratteristiche sociali o ambientali o una loro combinazione di cui all'art.8 del Regolamento (UE) 2019/2088, né ha come obiettivo la realizzazione di investimenti sostenibili di cui all'art. 9 del Regolamento (UE) 2019/2088.

#### Integrazione dei rischi di sostenibilità

Il Fondo, come illustrato nella comunicazione riguardante gli articoli 3,4,5 della Direttiva EU 2019/2088 (<https://www.fondopensionibnl.it/pdf/Informativa-SFDR-2088-con-data.pdf>) ha deciso di mitigare i rischi di sostenibilità attraverso un sistema di valutazione e monitoraggio dei rischi di sostenibilità nell'ambito della propria politica finanziaria promuovendo questo obiettivo definendo un impegno condiviso con i gestori a privilegiare emittenti che aderiscono agli standard di sostenibilità ESG.

Le metriche di valutazione dei rischi ESG utilizzate si fondano su una metodologia proprietaria sviluppata dall'Advisor di sostenibilità del Fondo (BNP Paribas Asset Management).

Essa consiste in una analisi quali-quantitativa basata su fattori di rischio attinenti a 11 tematiche ESG che sono misurate sulla base, in media, di 37 metriche settoriali sottostanti.

La metodologia è finalizzata alla generazione di "Rating" di sostenibilità riguardante gli oltre 12.000 titoli mobiliari con riferimento alle asset class azionaria e obbligazionaria.

Il "rating" di sostenibilità è costituito da 10 livelli di valutazione qualitativa, i decili, che sono aggiornati dall'Advisor di sostenibilità mensilmente al fine di consentire l'implementazione di tale metodologia all'interno del portafoglio nonché l'attivazione di un processo di monitoraggio in continuum e del controllo degli attivi.

La metodologia incorpora pienamente i principi di sviluppo sostenibile delle Nazioni Unite (PRI) e del Global Compact dell'OCSE.

Poiché è convinzione del Fondo che i fattori ambientali, sociali e di governance costituiscono tra le maggiori fonti di rischio per ogni investitore, il Fondo esclude esplicitamente dall'universo investibile i 3 decili di qualità più bassa e, per il tramite delle management company utilizzate, impone ai veicoli di Investimento utilizzati dal Fondo un apposito impegno vincolante relativamente agli investimenti azionari ed ai titoli di obbligazioni societarie.

Con riferimento, invece, agli investimenti mobiliari in OICVM e FIA, il Fondo analizza l'osservanza dei criteri ESG al momento della selezione degli stessi confrontando la compatibilità con la propria Policy con le politiche di sostenibilità offerte dagli OICR in gara.

## **Principali effetti negativi per la sostenibilità delle decisioni di investimento**

Il Fondo svolge report periodici sulle attività di investimento responsabile e sui profili ESG dei portafogli di investimenti mobiliari in OICVM.

Pur monitorando i rischi di sostenibilità, allo stato attuale il Fondo non ha perfezionato la definizione di una politica attiva di valutazione dei principali effetti negativi delle decisioni di investimento sui fattori di sostenibilità, avvalendosi della facoltà prevista al comma 1, lettera b) dell'articolo 4 del regolamento (UE) 2019/2088. I motivi di tale decisione sono elencati al paragrafo 5 comunicazione sulla sostenibilità ( <https://www.fondopensionibnl.it/pdf/Informativa-SFDR-2088-con-data.pdf> )

Il Fondo mantiene un approccio proattivo nella definizione degli indicatori e delle metriche con cui determinare i sopra menzionati impatti negativi, monitorando costantemente l'evoluzione delle disposizioni normative di riferimento nonché il mercato di fornitori di servizi legati a dati extra-finanziari.