CPR INVEST - B&W EUROPEAN STRATEGIC AUTONOMY 2028 - W EUR - DIST

LU2570612130

OBBLIGAZIONARIO | 31/10/2026

Informazioni chiave (Fonte : Amundi)

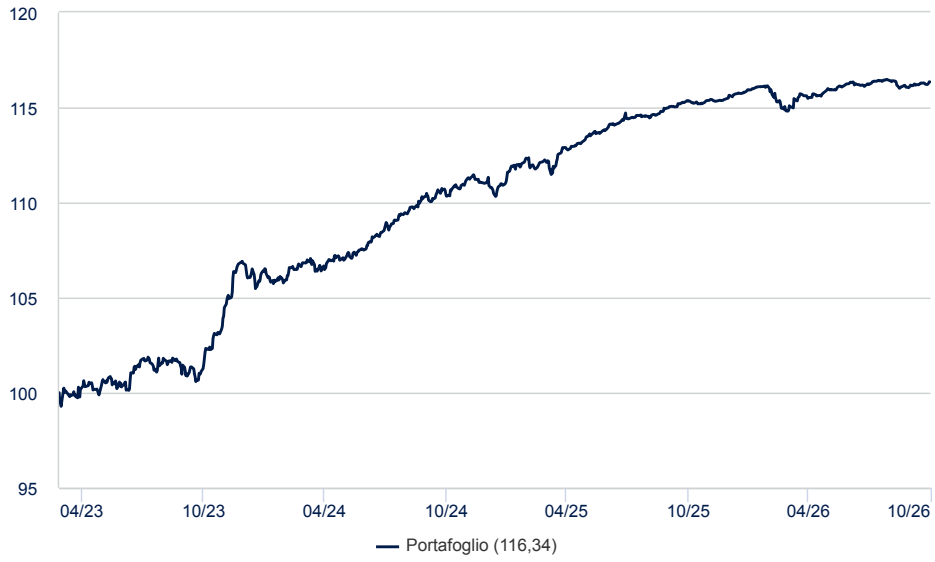
- **Valore quota (NAV) :** 106,93 (EUR)
- **Data di valorizzazione :** 30/10/2026
- **Patrimonio in gestione :** 179,62 (milioni EUR)
- **Codice ISIN :** LU2570612130
- **Benchmark :** Nessun Benchmark

STRATEGIA DI INVESTIMENTO *(Fonte : Grupo Amundi)*

L'obiettivo d'investimento è quello di generare reddito e un apprezzamento del capitale su un periodo di detenzione raccomandato di 5 anni, creando un portafoglio diversificato di credito "buy and watch", che contribuisca alla ripresa e alla resilienza europea, integrando nel contempo criteri ambientali, sociali e di governance (nel complesso, ESG) nel processo d'investimento. A tal fine, il Comparto mira a selezionare i titoli di società attive nei settori economici che hanno un legame diretto o indiretto con la resilienza europea e/o che contribuiscono all'autonomia e allo sviluppo economico dell'Europa, quali i prodotti alimentari, la sanità, l'industria, l'energia, il digitale e la difesa.

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

EVOLUZIONE DELLA PERFORMANCE SU BASE 100 *(Fonte : Fund Admin)*



Indicatore di rischio *(Fonte : Fund Admin)*

1	**2**	3	4	5	6	7

Rischio più basso — Rischio più alto

⚠ L'indicatore di rischio presuppone che il prodotto sia mantenuto per 5 anni.
L'indicatore sintetico di rischio è un'indicazione orientativa del livello di rischio di questo prodotto rispetto ad altri prodotti. Esso esprime la probabilità che il prodotto subisca perdite monetarie a causa di movimenti sul mercato o a causa della nostra incapacità di pagarvi quanto dovuto.

Abbiamo classificato questo prodotto al livello 2 su 7, che corrisponde alla classe di rischio bassa. Ciò significa che le perdite potenziali dovute alla performance futura del prodotto sono classificate nel livello basso e che è molto improbabile che le cattive condizioni di mercato influenzino la nostra capacità di pagarvi quanto dovuto. Altri rischi aggiuntivi: Il rischio di liquidità del mercato potrebbe amplificare la variazione dei risultati generati dal prodotto. Questo prodotto non comprende alcuna protezione dalla performance futura del mercato; pertanto potreste perdere il vostro intero investimento o parte di esso. Oltre ai rischi inclusi nell'indicatore di rischio, vi sono altri rischi che possono influire sul rendimento del Comparto. Si rimanda al prospetto di CPR Invest.

PERFORMANCE DI PERIODO *(Fonte : Fund Admin)* [1]

	Da inizio anno	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	Dal
A partire dal	**31/12/2025**	**30/09/2026**	**31/07/2026**	**31/10/2025**	**31/10/2023**	**-**	**27/03/2023**
Portafoglio	**0,61%**	**0,17%**	**0,10%**	**0,86%**	**4,66%**	**-**	**4,30%**

[1] I dati superiori ad un anno sono annualizzati

PERFORMANCE ANNUALE *(Fonte : Fund Admin)* [2]

	2025	2024	2023	2022	2021
Portafoglio	**4,14%**	**3,96%**	**-**	**-**	**-**

[2] Le performance passate non sono costanti nel tempo e non costituiscono un indicatore affidabile delle performance future. Gli investimenti sono soggetti alle fluttuazioni del mercato e possono variare verso l'alto e verso il basso.

* Fonte : Fund Admin. Le performance (cumulate) sono al lordo degli oneri fiscali e al netto di costi/commissioni. Le performance riportate si riferiscono a periodi completi di 12 mesi per ciascun anno civile. Il valore degli investimenti può variare al rialzo o al ribasso in base all'evoluzione dei mercati.

CPR INVEST - B&W EUROPEAN STRATEGIC AUTONOMY 2028 - W EUR - DIST

OBBLIGAZIONARIO

31/10/2026

TEAM DI GESTIONE



Zakaria Darouich

Head of Multi-Asset Solutions



Antoine Petit

Gestore di portafoglio supplente

Indicatori (Fonte : Amundi)

	Portafoglio
Modified Duration [1]	0,92
Yield	4,98%
Spread [2]	121
Numero titoli	62

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

[2] Spread: differenza di rendimento tra un'obbligazione corporate e un'obbligazione di Stato.

[3] SPS: Sensibilità Ponderata dallo Spread

ANALISI DEL RISCHIO *(Fonte : Fund Admin) **

	1 anno	3 anni	5 anni	Data di lancio *
Volatilità	**0,87%**	**1,78%**	**-**	**2,09%**
Sharpe Ratio del portafoglio	-1,40	0,92	-	0,76

* Dati annualizzati

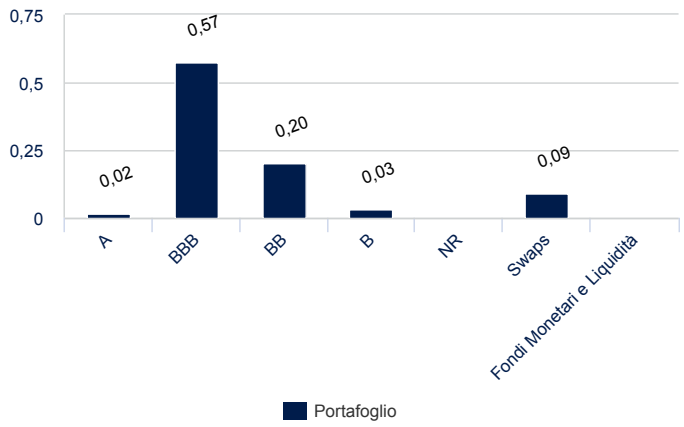
CPR INVEST - B&W EUROPEAN STRATEGIC AUTONOMY 2028 - W EUR - DIST

OBBLIGAZIONARIO

31/10/2026

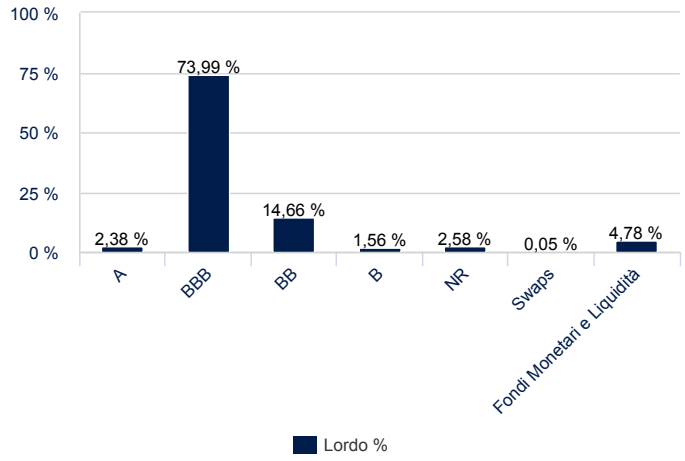
Ripartizione per Rating (Fonte : Amundi)

Modified Duration (Fonte : Amundi)



Derivati inclusi

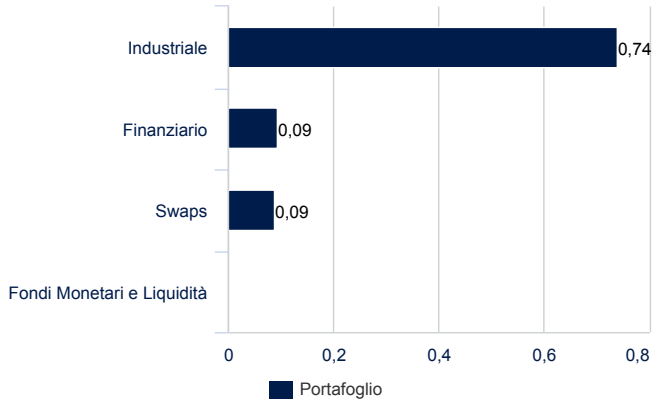
In percentuale dell'attivo *



* Il totale può essere diverso dal 100%, poichè la liquidità da regolare è esclusa

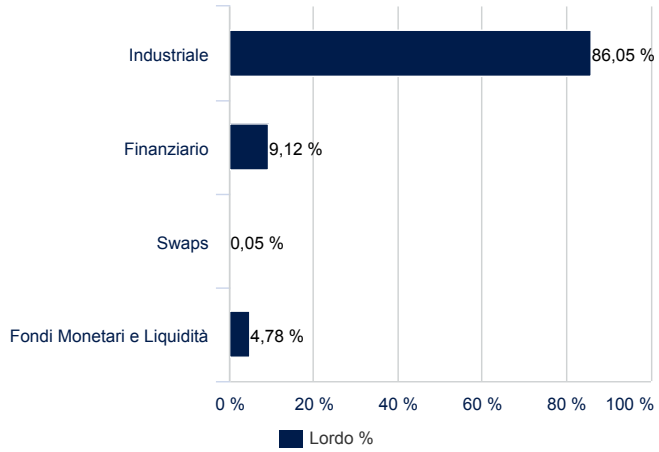
Ripartizione per emittente (Fonte : Amundi)

Modified Duration (Fonte : Amundi)



Derivati inclusi

In percentuale dell'attivo *



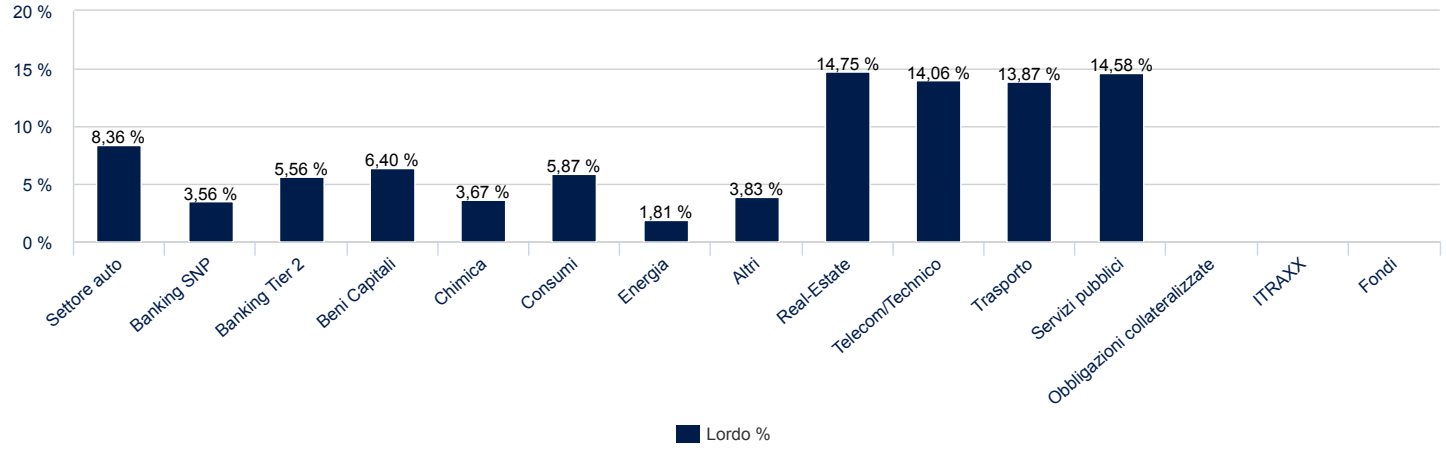
* Il totale può essere diverso dal 100%, poichè la liquidità da regolare è esclusa

CPR INVEST - B&W EUROPEAN STRATEGIC AUTONOMY 2028 - W EUR - DIST

OBBLIGAZIONARIO

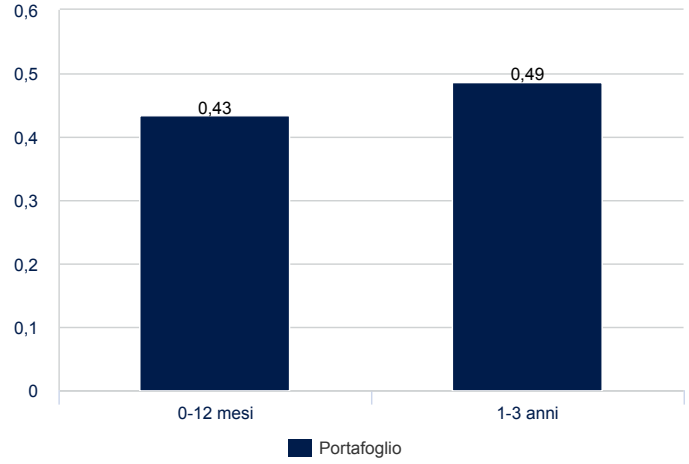
31/10/2026

Sector Allocation (% of assets)

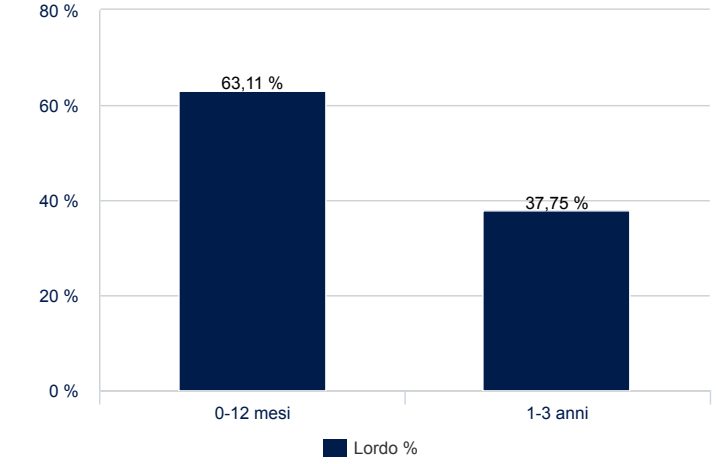


Ripartizione per Area di Curva (Fonte : Amundi)

In punti di Modified Duration

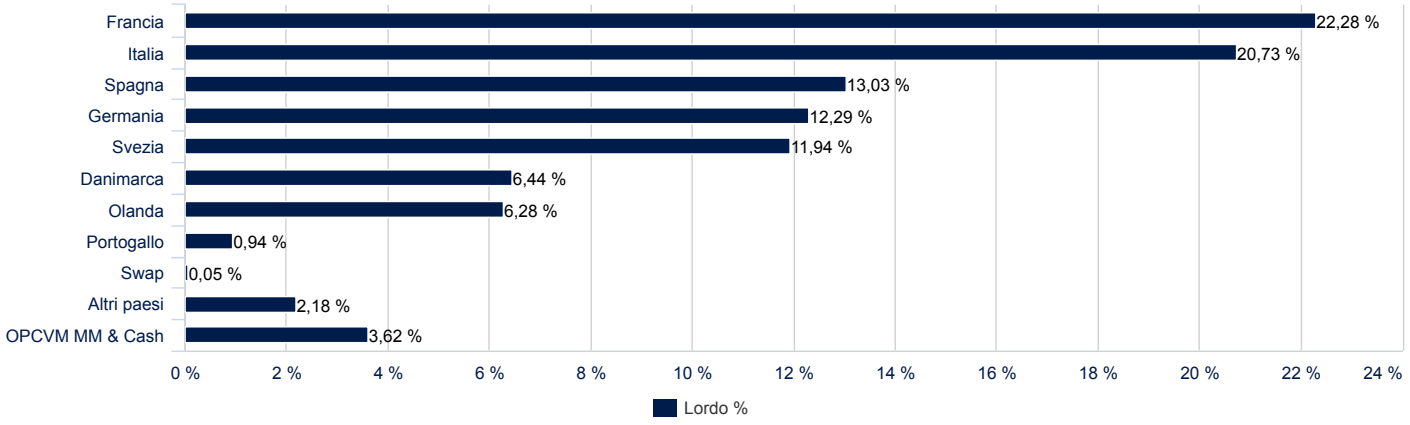


In percentuale dell'attivo



Ripartizione per Paese (Fonte : Amundi)

In percentuale dell'attivo

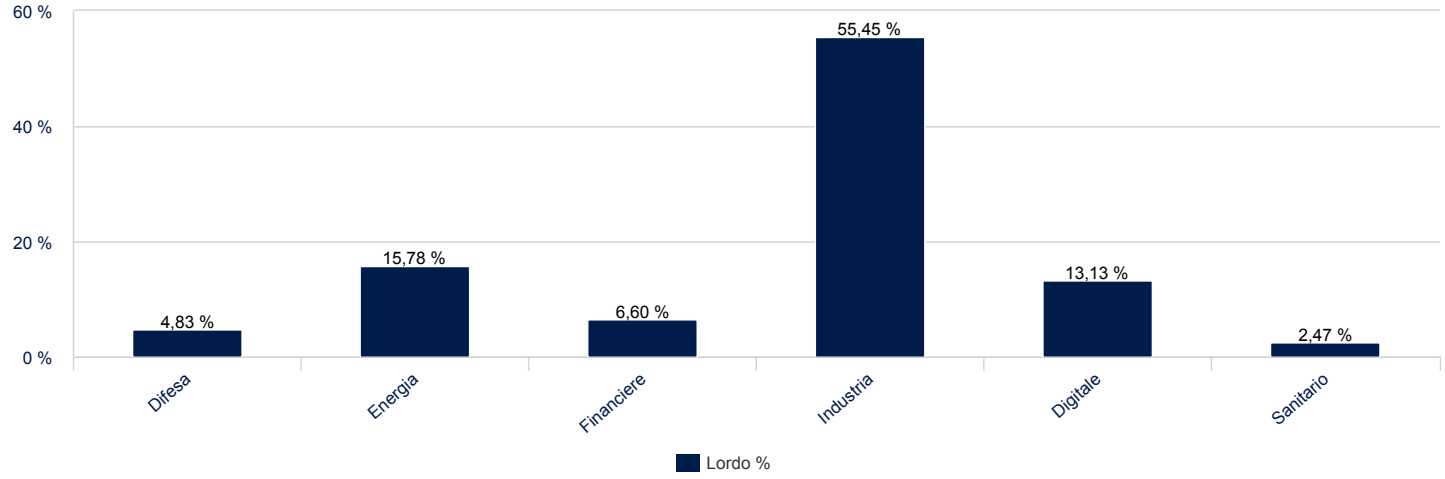


Questo documento è esclusivamente destinato agli investitori « professionali »
CPR Asset Management, S.A. con un capitale sociale di 61 461 945 €, 399 392 141 RCS Paris - Società di gestione con numero di autorizzazione GP01-056 rilasciata da AMF
91-93, Boulevard Pasteur 75015 Paris - France - 01 53 15 70 00
www.cpram.com

CPR INVEST - B&W EUROPEAN STRATEGIC AUTONOMY 2028 - W EUR - DIST

OBBLIGAZIONARIO 31/10/2026

Ripartizione tematica



Principali posizioni (Fonte : Amundi)

	Settore	% di attivi
ERG SPA	Industriale	4,07
ASTM SPA	Industriale	3,62
BANCO SANTANDER SA	Finanziario	3,60
ARCADIS NV	Industriale	3,60
SAGAX EURO MTN NL BV	Industriale	3,51
GRAND CITY PROPERTIES SA	Industriale	3,46
BPCE SA	Finanziario	1,92
SOCIETE GENERALE SA	Finanziario	1,64
CREDIT AGRICOLE SA	Finanziario	1,02
BNP PARIBAS SA	Finanziario	0,73

CPR INVEST - B&W EUROPEAN STRATEGIC AUTONOMY 2028 - W EUR - DIST

OBBLIGAZIONARIO 31/10/2026

Caratteristiche principali (Fonte : Amundi)

Forma giuridica	OICVM di diritto lussemburghese
Società di gestione	CPR ASSET MANAGEMENT
Banca depositaria	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Data di creazione del comparto	27/03/2023
Data di lancio	27/03/2023
Valuta di riferimento del comparto	EUR
Valuta di riferimento della classe	EUR
Tipologia dei dividendi	Distribuzione
Codice ISIN	LU2570612130
Sottoscrizione minima iniziale	1 millesimo/i di azione/quota / 1 millesimo/i di azione/quota
Frequenza di calcolo della quota	Giornaliera
Ora limite di ricezione degli ordini	Istruzioni pervenute giornalmente G entro 14:00
Spese di sottoscrizone (massimo)	2,25%
Commissioni legate al rendimento	No
Spese di rimborso (massimo)	0,00%
Commissioni di gestione e altri costi amministrativi o di esercizio	1,05%
Costi di transazione	0,01%
Spesa di conversione	5,00 %
Orizzonte d'investimento minimo consigliato	5 anni

CPR INVEST - B&W EUROPEAN STRATEGIC AUTONOMY 2028 - W EUR - DIST

OBBLIGAZIONARIO

31/10/2026

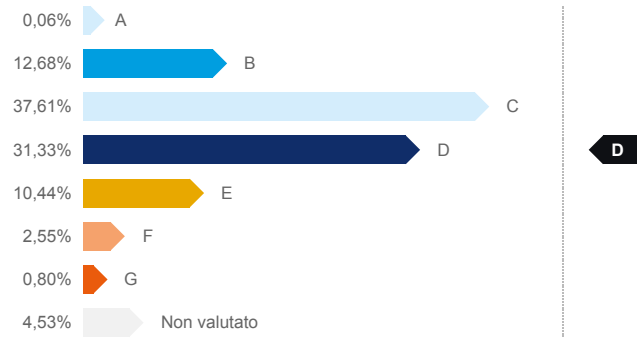
Punteggio medio ESG del portafoglio del Fondo e confronto con il punteggio ESG medio del suo universo di investimento

Valutazione ambientale, sociale e di governance. Informazioni sugli aspetti legati alla sostenibilità sono disponibili su https://about.amundi.com/legal-documentation

Del Portafoglio



Dell'universo di riferimento



Valutazione in base ai criteri ESG (Fonte : Amundi)

	Portafoglio	Benchmark
Environment	C	C
Sociale	C	D
Governance	D	D
Rating Globale	**C**	**D**

Benchmark ESG: 40% ICE BOFA BB-B EURO HIGH YIELD CONSTRAINED INDEX + 60% ICE BOFA 3-5 YEAR EURO CORPORATE INDEX

Copertura della Analisi ESG (Fonte : Amundi)

Numero di emittenti	**62**
% del portafoglio	100%

²Titoli degni di nota secondo i criteri ESG, esclusi i contanti.

Definizioni e fonti

Investimento responsabile (IR)

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

Vengono utilizzati criteri extra-finanziari per valutare le pratiche ambientali, sociali e di governance di aziende, Stati o comunità:

o "E" per Ambiente: consumo di energia, emissioni di gas serra, gestione dell'acqua e dei rifiuti, ecc.
o "S" per Social/Società: rispetto dei diritti umani, salute e sicurezza sul lavoro, ecc.
o "G" per Governance: indipendenza del consiglio di amministrazione, rispetto dei diritti degli azionisti, ecc.

La scala di rating del Gruppo Amundi classifica gli emittenti da A a G, dove A rappresenta i migliori emittenti e G i peggiori.

CPR INVEST - B&W EUROPEAN STRATEGIC AUTONOMY 2028 - W EUR - DIST

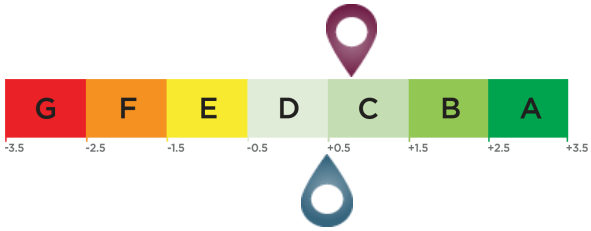
OBBLIGAZIONARIO

31/10/2026

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

Valutazione ambientale, sociale e di governance. Informazioni sugli aspetti legati alla sostenibilità sono disponibili su https://about.amundi.com/legal-documentation

Universo di investimento ESG del Fondo: 40% ICE BOFA BB-B EURO HIGH YIELD CONSTRAINED INDEX + 60% ICE BOFA 3-5 YEAR EURO CORPORATE INDEX



Punteggio ESG medio del portafoglio del Fondo: 0,77

Punteggio ESG medio dell'universo di investimento del Fondo[1]: 0,47

Copertura ESG (fonte: Amundi) *

	Portafoglio	Benchmark
% del portafoglio con un rating ESG[2]	100,00%	95,44%
% del portafoglio che può beneficiare di un rating ESG[3]	99,66%	100,00%

* Titoli che possono essere valutati secondo criteri ESG. Il totale può essere diverso dal 100% per riflettere l'esposizione reale del portafoglio (incluso il denaro liquido).

Terminologia 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.

Note ESG

Rating ESG dell'emittente: Amundi si è dotata di un sistema proprietario per l'attribuzione dei rating ESG agli emittenti e basa la propria analisi su un approccio Best-in-class. Ciascun emittente viene valutato attraverso l'attribuzione di un punteggio formulato in termini quantitativi misurato rispetto alla media del suo settore, in modo da attuare una distinzione tra le migliori pratiche e quelle peggiori a livello settoriale. La valutazione di Amundi si basa su una combinazione di dati extra-finanziari di terze parti e su un'analisi qualitativa del settore associato e dei profili di sostenibilità. Il punteggio quantitativo viene quindi tradotto in una scala di rating che classifica l'emittente su una scala alfabetica di 7 livelli che va da "A" (punteggio più alto, nel grafico il rating "A" è rappresentato dai valori compresi tra +2.5 e +3.5) per le migliori pratiche a "G" (punteggio più basso, nel grafico il rating "G" è rappresentato dai valori compresi tra -2.5 e -3.5) per le peggiori. Queste ultime sono escluse dai prodotti finanziari gestiti attivamente.

Approccio di Amundi all'integrazione ESG

Poiché Amundi intende procedere alla generalizzazione dei criteri ESG nei propri portafogli, oltre a rispettare la Politica d'investimento responsabile di Amundi[4], il suo approccio all'integrazione degli aspetti ESG ha lo scopo di ottenere un punteggio medio ESG di portafoglio superiore al punteggio ESG medio del rispettivo universo d'investimento. Le valutazioni, operate da un team di analisti dedicato e formulate in modo autonomo rispetto al team di gestione, sono utilizzate dai gestori dei portafogli nelle scelte di investimento in aggiunta agli altri criteri finanziari. Il punteggio ESG rappresenta una fondamentale fonte di informazioni per i gestori di portafoglio per poter tenere conto dei rischi di sostenibilità nelle loro decisioni di investimento. Il punteggio ESG intende misurare la performance ESG di un emittente, ad esempio la sua capacità di anticipare e gestire i rischi e le opportunità di sostenibilità inerenti al suo settore e alle sue condizioni specifiche. Il punteggio ESG di Amundi valuta altresì la capacità dell'azienda di controllare il potenziale impatto negativo delle sue attività sui fattori di sostenibilità.

[1] L'universo d'investimento di riferimento è definito dall'indice di riferimento del fondo o da un indice rappresentativo dell'universo investibile sulla base dei criteri ESG.
[2] Percentuale di titoli con un rating Amundi ESG rispetto al totale del portafoglio (ponderazione)
[3] Percentuale di titoli ai quali è applicabile una metodologia di rating ESG rispetto al totale del portafoglio (ponderazione)
[4] Il documento aggiornato è disponibile all'indirizzo https://www.amundi.com/int/ESG.

GLOBI



Il livello di sostenibilità è un rating generato da Morningstar che mira a misurare in modo indipendente il grado di responsabilità di un fondo in base ai titoli in portafoglio. La valutazione va da molto bassa (1 globo) a molto alta (5 globi).

Fonte Morningstar © Sustainability Score - sulla base delle analisi del rischio ESG societario fornite da Sustainalytics utilizzate nel calcolo del Sustainability score di Morningstar. © 2026 Morningstar. Tutti i diritti riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono di proprietà di Morningstar e/o dei suoi fornitori di contenuti; (2) non possono essere riprodotte o ridistribuite; e (3) non sono garantite in quanto ad accuratezza, completezza o tempestività. Né Morningstar né i suoi fornitori di contenuti rispondono di eventuali danni o perdite derivanti dall'utilizzo di queste informazioni. I rendimenti passati non sono una garanzia dei risultati futuri. Per ulteriori informazioni sul rating Morningstar, si prega di consultare il sito web www.morningstar.com.