

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 9, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Nom du produit : Abacus Green Deal

Numéro LEI ("Legal entity identifier"): 969500FKI69A5I6IU646

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?



Oui



Non



Il réalisera un minimum d'investissements **durables ayant un objectif environnemental**:

___%



dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



Il réalisera un minimum d'investissements **durables ayant un objectif social**: 80 %



Il promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il contiendra une proportion minimale de 0 % d'investissements durables.



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif socialith a social objective



Il promeut des caractéristiques E/S, mais ne réalisera pas d'investissements durables

L'investissement durable est un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, à condition que l'investissement ne nuise pas de manière significative à un objectif environnemental ou social et que les entreprises bénéficiaires de l'investissement suivent des pratiques de bonne gouvernance.

La Taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020 /852, qui dresse une liste d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Ce règlement ne dresse pas de liste d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure l'objectif d'investissement durable de ce produit financier a-t-il été atteint?

Abacus Green Deal est un fonds actions thématique et à impact. Son objectif est d'investir de manière durable et de contribuer significativement et positivement aux enjeux de la transition énergétique et écologique et à la lutte contre le réchauffement climatique. Le portefeuille est composé d'actions de sociétés de toutes capitalisations dont le modèle économique, les produits ou les services répondent, selon notre analyse, à l'objectif du fonds de contribuer au développement durable. Le fonds a un objectif d'investissement durable conformément à l'article 9 du règlement SFDR (UE) 2019/2088. Formellement, le fonds s'engage à investir dans les émetteurs durables (80% de l'actif net) ayant un ou plusieurs objectifs environnementaux. Cette proportion est contraignante. Le fonds veille aussi de

manière supplétive à l'investissement durable ayant un ou plusieurs objectifs sociaux sans déterminer de proportion minimale.

Afin d'atteindre cet objectif, l'équipe de gestion a mis en place plusieurs mesures.

Dès la détermination de l'univers investissable, avec l'exclusion des entreprises non éligibles à la Taxonomie, l'équipe de gestion veille à ce que sont investissables uniquement des entreprises dont les activités participent dans la transition écologique et qui opèrent dans des secteurs cruciaux pour le développement durable.

De plus, lors de la construction du portefeuille, seules entreprises considérées sont celles conformes à nos thématiques d'investissement et celles présentant un impact intentionnel et mesurable. Enfin, l'équipe de gestion veille de manière continue à la proportion durable du portefeuille. La durabilité de chaque entreprise est calculée sur la base de trois critères :

- 1) La contribution significative à un ou plusieurs Objectifs de développement durable (ODD)
- 2) L'absence de préjudice significatif pour l'environnement et la société ;
- 3) La bonne gouvernance.

En cohérence avec le thème d'investissement du fonds, nous privilégions les actifs qui contribuent aux objectifs environnementaux.

Pendant la période de reporting, du juillet 2022 au décembre 2022, la proportion de l'investissement durable atteint 92%. Le fonds investissait des entreprises durables dans leur globalité. La sélection a été telle que toutes les entreprises contribuaient à plusieurs objectifs de développement durable environnementaux et sociaux. Dans ce sens, la proportion d'investissement durable ayant un ou plusieurs objectifs environnementaux est de 92%, ainsi, celle ayant un ou plusieurs objectifs sociaux est de 92%.

De plus, le fonds est construit et géré selon les contraintes suivantes :

- D'assurer que toute valeur en portefeuille est investissable selon l'approche de sélectivité Best-in-Universe excluant les 20% d'émetteurs les moins bien notés, tous secteurs confondus
- D'assurer que la sélection de valeurs en portefeuille atteint une meilleure note ESG que celle de l'indice de référence ;
- D'assurer un taux de couverture de l'analyse ESG du portefeuille supérieur à 90% de l'actif net. En effet, sont analysés au minimum 90% des instruments financiers composant le portefeuille, à l'exclusion de la trésorerie (liquidités, compte "Banque") et des obligations et des titres de créances émis par des émetteurs publics ou quasi publics;

Ces objectifs font l'objet d'un suivi régulier et d'un rapport mensuel. Ils doivent nécessairement être respectés. Dans le cas échéant, le fonds dispose d'une semaine pour remettre en ordre les ratios.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité

Les indicateurs de durabilité servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Moyenne 2022		ODD 3 Bonne santé	ODD 4 Education de qualité	ODD 5 Egalité des sexes	ODD 8 Travail décent	ODD 10 Réduction des inégalités
Durable obj. social sur 100%		1,37%	29,33%	22,92%	12,73%	25,26%
Durable obj. envi sur 100%		7,14%	38,83%	16,56%	18,35%	10,73%
Total moyenne 2022 :						
Investissement durable :	Social			91,61%		
	Environnemental			91,61%		
	Total :			91,61%		
Proportion DNSH :						5,1%
Proportion Gov :						4,9%
Aucune contribution :						0,3%
Non durable						8,63%

● et par rapport aux périodes précédentes ?

Le fonds Abacus Green Deal a été lancé en juillet 2022. Le rapport 2022 est le premier disponible.

● Dans quelle mesure les investissements durables n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable ?

Tel qu'indiqué dans l'Annexe III, le fonds définit le préjudice aux objectifs environnementaux, selon l'article 17 du Règlement (UE) 2020/852, plus particulièrement par la pollution issue des combustibles fossiles. En absence de cadre réglementaire relatif aux objectifs sociaux, le fonds se focalise principalement sur les violations graves des droits de l'Homme et du droit humanitaire.

Afin d'assurer que le fonds n'investit pas dans les entreprises susceptibles de causer un préjudice substantiel aux objectifs environnementaux et sociaux, plusieurs filtres d'exclusions sont déterminés. Ainsi, le fonds veille de manière continue à ce qu'aucun titre investi n'ait adopté de comportement controversé ou commis de préjudice grave. Si un tel cas était établi, la procédure de gestion des controverses serait déclenchée et pourrait résulter en exclusion de l'entreprise du portefeuille et de l'univers. Pendant la période du juillet 2022 au fin décembre 2022, aucun tel cas n'a été enregistré.

Premièrement, le produit a mis en place une politique d'exclusion commune à tous les fonds afin d'éviter l'investissement dans certaines activités controversées ayant un impact négatif sur les facteurs de durabilité.

Ceci est applicable à l'ensemble du portefeuille. Sont exclues les activités liées à la fabrication et au stockage d'armes controversées conformément aux conventions d'Ottawa et d'Oslo, ainsi qu'à la Convention sur l'interdiction des armes biologiques (1975) et des armes chimiques (1997), ainsi que celles qui se trouvent en violation des 10 principes du Pacte mondial des Nations Unies et ceux qui enfreignent les Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales, tels qu'applicables à toute société de gestion française. Sont également exclues les entreprises exerçant des activités liées aux combustibles fossiles, plus particulièrement celles impliquées dans les activités liées à l'extraction, au transport et à la production d'électricité à partir du charbon, celles impliquées dans l'extraction, la transformation et le transport du pétrole et du gaz naturel (0 % du chiffre

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

d'affaires issu pétrole et charbon, à l'exception du gaz naturel < 30%). Les entreprises impliquées dans la production de tabac ainsi que celles impliquées dans l'industrie du divertissement pour adultes sont également exclues.

Cette étape permet d'exclure de l'univers d'investissement toute entreprise susceptible de commettre un préjudice grave et substantiel aux objectifs environnementaux, tels que la pollution issue des combustibles fossiles, et sociaux tels que les violations graves des droits de l'Homme et du droit humanitaire.

De plus, nous filtrons notre univers selon la liste d'exclusion de l'Université de Yale concernant les activités économiques en Russie depuis le début de la guerre. A ce titre, plusieurs entreprises classées D (entreprises qui ont suspendu les nouveaux investissements/développement) et F (entreprises qui résistent aux demandes de retrait ou de réduction d'activités) ont été exclues de l'univers investissable.

Dans un second temps, le fonds filtre son univers d'investissement à travers une analyse ESG initiale en excluant les 20% des émetteurs les moins bien notés afin d'exclure toute entreprise présentant un risque élevé d'impact négatif. Cette étape permet d'exclure toute entreprise n'ayant pas pris en compte leur responsabilités environnementale, sociale, sociétale et en matière de gouvernance, et n'ayant pas mis en place des mesures afin d'éviter des préjudices, tels que ceux déterminés par l'article 17 du Règlement (UE) 2020/852, ou par exemple de nuire à leurs employés, sous-traitants, à la société par la corruption et un comportement contraire à l'éthique, etc.

Ces filtres permettent au portefeuille d'assurer de ne pas causer de préjudice important à l'objectif d'investissement durable. Pendant la période du juillet 2022 au fin décembre 2022, le taux d'investissabilité a été assuré à minima à 90%.

Troisièmement, le fonds a intégré une analyse approfondie d'absence de préjudice aux objectifs environnementaux et aux objectifs sociaux. Cette analyse fait partie de notre analyse de la durabilité. La proportion du portefeuille non durable n'a pas dépassé 10% pendant la période du rapport.

Enfin, le fonds a intégré des critères de controverse tant dans l'analyse ESG initiale que dans l'analyse approfondie, concernant respectivement la détermination de l'univers d'investissement et la construction du portefeuille. Ils traduisent directement des comportements controversés, concernant la responsabilité environnementale, sociale ou sociétale des actifs. Ces critères sont évalués dans le processus de prise de décision d'investissement et peuvent interdire l'investissement conformément à notre politique de gestion des controverses.

● ***Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?***

Tel qu'indiqué dans l'Annexe III, les 14 principaux indicateurs d'impacts négatifs sur les facteurs de durabilité énumérés dans le tableau 1 ainsi qu'une sélection d'indicateurs supplémentaires dans les tableaux 2 et 3 de l'annexe I du Rectificatif au règlement délégué

(UE) 2022/1288 publié le 27 décembre 2022, sont intégrés dans l'analyse ESG ainsi que plus de 110 autres KPI pertinents.

Les indicateurs d'impacts négatifs sont catégorisés et intégrés selon quatre grandes thématiques : responsabilité environnementale, responsabilité sociale, responsabilité sociétale et gouvernance d'entreprise. Les quatre thèmes correspondent respectivement à quatre piliers : environnement, social, sociétal et gouvernance. Les quatre piliers sont notés indépendamment, puis combinés en un score final de l'entreprise sur 100.

Les indicateurs d'incidences négatives sont intégrés dans l'analyse ESG. Le portefeuille veille à ce que le taux de couverture de l'analyse ESG est toujours supérieur à 90% de l'actif net. Le taux est suivi et archivé tous les jours. Dans ce sens, la prise en considération des incidences est assurée de manière quotidienne.

Pour plus de détails sur les indicateurs pris en considération dans nos outils d'analyse ESG, voir l'Annexe III.

Les données ESG sont principalement extraites de Bloomberg. Pour toutes les entreprises dans le portefeuille, nous procédons nécessairement à l'analyse approfondie, afin de vérifier la donnée extraite, la compléter ou même afin d'analyser l'entreprise dont nous n'avons pu extraire aucune donnée. Cela comprend une lecture détaillée des rapports annuels, rapports de la durabilité, politiques ESG, codes de conduites etc. Cela augmente considérablement le taux de couverture pour tous les indicateurs. De plus, notre analyse ESG est basée sur la matérialité variable, donc sur 130 critères ESG dans notre analyse ESG, une centaine est estimée pertinente pour chaque entreprise par rapport à son secteur et type d'activité. Dans ce sens, le taux de couverture de certains indicateurs peut être faible dans sa globalité, mais quant à la couverture par les entreprises visées le taux est satisfaisant afin d'obtenir une note crédible.

Les indicateurs d'impacts négatifs sont notés selon une matérialité variable. Au sein de chaque pilier, les pondérations des catégories et des critères varient selon la pertinence du critère considéré pour chacun des onze secteurs d'activité couverts par notre modèle. Certains critères sont plus pertinents et significatifs que d'autres pour chaque secteur d'activité. En ce sens, plus le secteur est susceptible de produire des effets négatifs sur ces facteurs, plus le critère sera important et plus rigoureusement noté.

L'analyse ESG initiale et l'analyse ESG approfondie sont fondées sur un système de notation similaire, dont les quatre piliers sont les mêmes, et dont la pondération dépend des spécificités du fonds.

- L'analyse ESG initiale est faite pour toute entreprise de l'univers de départ filtré. Elle prend en compte 70 critères quantitatifs relatifs aux 4 piliers susmentionnés. Elle note les entreprises par rapport à la moyenne générale de l'indice de référence du fonds, soit la moyenne de l'indice sur chaque critère de l'analyse. La notation est faite indépendamment du secteur et du type d'activité afin d'évaluer les performances de chaque entreprise à périmètre équivalent.
- L'analyse ESG approfondie est faite juste avant la construction finale du portefeuille sur une sélection de valeurs et celles déjà investies. Ainsi, l'analyse ESG approfondie est spécifique pour chaque entreprise individuellement. Elle prend en compte 130 critères quantitatifs et qualitatifs et adopte une approche plus contextualisée et ciblée. La

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir: 1 janvier 2022 au 31 décembre 2022.fiscales.

notation est faite en prenant compte du secteur et du type d'activité. Notamment, au sein de chaque pilier, les pondérations des catégories de critères varient en fonction de la pertinence du critère considéré pour chacun des 11 secteurs d'activités couverts par le modèle.

- ***Les investissements durables étaient-ils conformer aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droit de l'homme ? Description détaillée :***

La mission du produit financier est d'investir de manière durable et responsable. En ce sens, nous investissons conformément aux standards internationaux des droits de l'Homme et du droit humanitaire. Nous avons formulé une politique d'exclusion qui fait référence aux normes internationales définissant les comportements controversés et définissant le seuil minimum de comportement acceptable nécessaire pour prévenir les violations graves des droits fondamentaux et du droit humanitaire.

En matière de protection des droits de l'Homme, notre politique se réfère aux 10 principes du Pacte mondial et aux lignes directrices de l'OCDE.

Le fonds exclut tout investissement dans des entreprises dont le comportement constitue une violation de ces droits. En ce sens, les entreprises qui enfreignent les dix principes du Pacte mondial des Nations Unies et les entreprises qui enfreignent les Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales sont exclues de l'univers d'investissement.

Ce filtre permet au portefeuille d'assurer de ne pas causer de préjudice important à l'objectif d'investissement durable. Pendant la période du juillet 2022 au fin décembre 2022, le taux d'investissabilité a été assuré à minima à 90%.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité

Les principales incidences négatives sur la durabilité sont définies comme les impacts des décisions d'investissement entraînant des effets négatifs sur les facteurs de durabilité. Peuvent être ainsi affectés des facteurs environnementaux, sociaux et sociétaux touchant aux sujets du respect des droits de l'Homme, de la pollution, de la corruption et d'autres.

En ce sens, nous veillons à ce que nos décisions d'investissement et nos choix des allocations ne produisent pas l'effets négatifs sur ces facteurs.

Notre politique d'investissement responsable explicite le processus de diligence raisonnable comprenant les incidences négatives de nos décisions d'investissement. Cette politique vise à assurer que ces incidences sont dûment prises en compte et qu'elles informent les décisions d'investissement et de gestion du portefeuille conformément aux exigences réglementaires.

Nous avons sélectionné des indicateurs d'incidence négative sur la base de leur importance, disponibilité, probabilité de survenance et le caractère potentiellement grave ou irréversible de leurs conséquences. Nous nous appuyons sur les standards internationaux, référentiels dans la matière, ainsi que les guides des agences tels que AFG. De plus, nous veillons à la conformité de notre outil d'analyse par rapport à la réglementation en place, tel que le RTS (Regulatory Technical Standards) qui vient compléter le règlement Disclosure.

Les principales incidences négatives telles que définies par l'Annexe I du Rectificatif au règlement délégué (UE) 2022/1288 publié le 27 décembre 2022 font partie de nos outils d'analyse ESG initiale et approfondie. La performance du fonds par rapport aux incidences négatives est suivie de manière mensuelle. Le fonds publie des rapport PAI (Principe adverse impacts) de manière trimestrielle sur le site et annuelle dans le Rapport annuel consolidé article 29 et PAI.

Pour plus de détails et la liste des principales incidences négatives, veuillez consulter nos politiques et rapports ESG disponibles sur notre site.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Schneider Electric	Industrie	4,9%	France
Bureau Veritas	Industrie	4,6%	France
Solaria	Services aux collectivités	4,1%	Espagne
Verallia	Matériaux	3,6%	France
Seche environnement	Industrie	3,5%	France



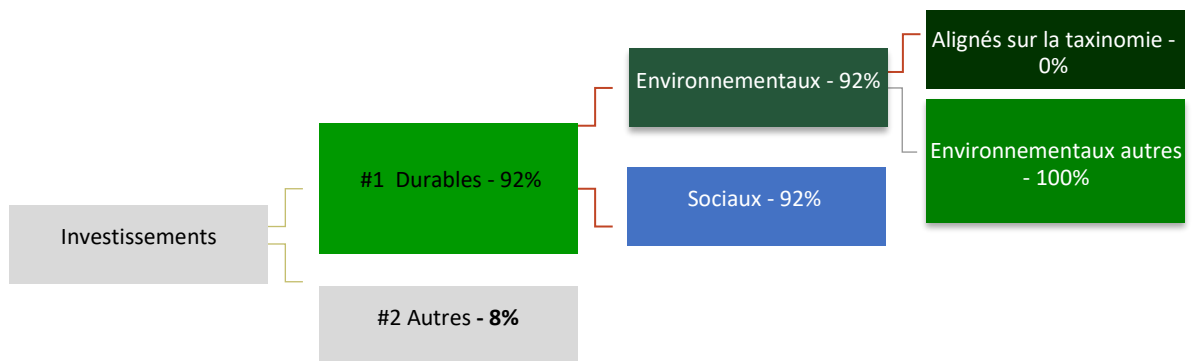
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Entre janvier 2022 et fin décembre 2022, le portefeuille atteint 92% d'investissement lié à la durabilité, contribuant à un ou plusieurs objectifs de développement durable environnementaux et sociaux.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.

Quelle était l'allocation des actifs



Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Abacus Green Deal est un fonds thématique et impact. Notamment, le fonds vise à contribuer à la transition écologique et énergétique. Les investissements sont répartis entre cinq thématiques : production d'énergie renouvelable, efficacité énergétique, économie circulaire, ressources durables et technologies innovantes. Dans ce sens, le portefeuille est fortement exposé à certains secteurs, et très peu à d'autres. La répartition sectorielle est la suivante :

Sector	Pondération 2022
Consommation de base	0%
Consommation discrétionnaire	2%
Energie	0%
Finance	0%
Immobilier	0%
Industrie	41%
Matériaux	21%
Services aux collectivités	26%
Services de communication	6%
Soins de santé	2%
Technologies de l'information	3%



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxonomie de l'UE ?

Le produit financier investit-il dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE*?



Oui



Non

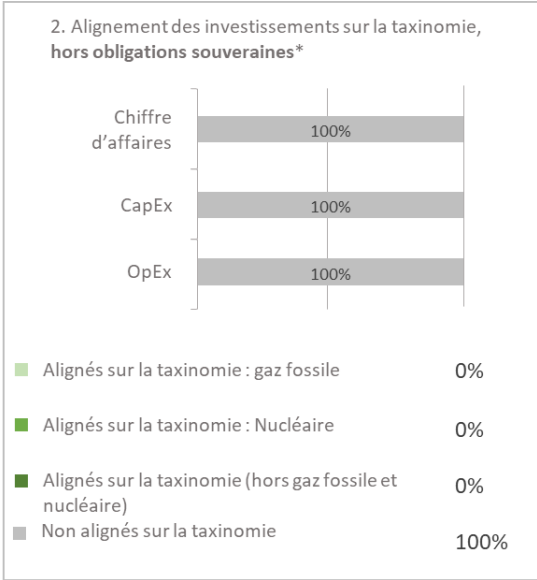
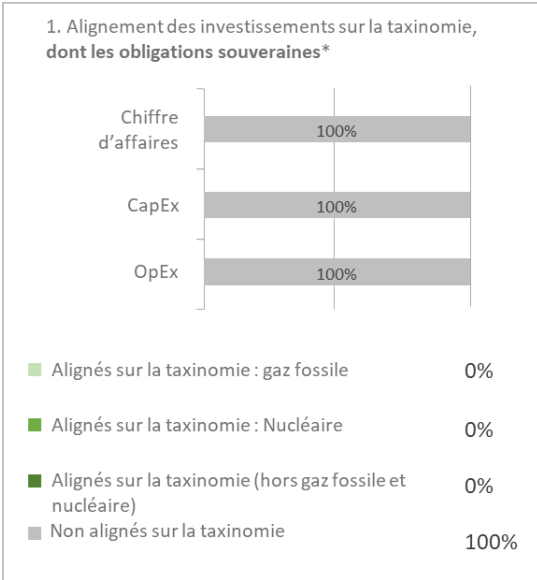
*Les activités liées au gaz fossile et/ ou nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'Ue que si elles contribuent à limiter le changement climatique ("atténuation du changement climatique") et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche.

L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commissions.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables **au gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les activités habilitantes permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

0%

● **Comment le pourcentage d'investissement alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le fonds Abacus Green Deal a été lancé en juillet 2022. Le rapport 2022 est le premier disponible.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

92%



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

92%



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie "autres", quelle était leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La poche "#2 Non durable" contient principalement des liquidités auxiliaires et des dérivés de couverture.

Ainsi, la poche non durable contenait des actifs que notre analyse considère comme pertinents pour un ou plusieurs objectifs durables, mais qui ne remplissaient pas les deux autres critères de durabilité (l'absence de préjudice et la bonne gouvernance). Comme le portefeuille a vocation à être durable, ces investissements ne dépassaient pas 10% de la valeur du portefeuille couvert. Ces investissements sont principalement ceux pour lesquels il n'existe pas suffisamment de données ESG. Ils doivent toutefois respecter les garanties

minimales de notre sélection négative conformément à la politique d'exclusion. Nous nous adressons à toute entreprise potentielle ou investie qui ne fournit pas les données nécessaires à travers un questionnaire sur sa performance ESG.

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Tel qu'indiqué dans la question 4, afin d'atteindre cet objectif, l'équipe de gestion a mis en place plusieurs mesures.

Dès la détermination de l'univers investissable, avec l'exclusion des entreprises non éligibles à la Taxonomie, l'équipe de gestion veille à ce que sont investissables uniquement des entreprises dont les activités participent dans la transition écologique et qui opèrent dans des secteurs cruciaux pour le développement durable.

Lors de la construction du portefeuille, seules entreprises considérées sont celles conformes à nos thématiques d'investissement et celles présentant un impact intentionnel et mesurable. Enfin, l'équipe de gestion veille de manière continue à la proportion durable du portefeuille. La durabilité de chaque entreprise est calculée sur la base de trois critères :

- 1) La contribution significative à un ou plusieurs Objectifs de développement durable (ODD)
- 2) L'absence de préjudice significatif pour l'environnement et la société ;
- 3) La bonne gouvernance.

De plus, le fonds est construit et géré selon les contraintes suivantes :

- D'assurer que toute valeur en portefeuille est investissable selon l'approche de sélectivité Best-in-Universe excluant les 20% d'émetteurs les moins bien notés, tous secteurs confondus
- D'assurer que la sélection de valeurs en portefeuille atteint une meilleure note ESG que celle de l'indice de référence ;
- D'assurer un taux de couverture de l'analyse ESG du portefeuille supérieur à 90% de l'actif net. En effet, sont analysés au minimum 90% des instruments financiers composant le portefeuille, à l'exclusion de la trésorerie (liquidités, compte "Banque") et des obligations et des titres de créances émis par des émetteurs publics ou quasi publics;
- D'assurer un taux d'investissement durable à 80% de l'actif net.

Ces objectifs font l'objet d'un suivi régulier et d'un rapport mensuel. Ils doivent nécessairement être respectés. Dans le cas échéant, le fonds dispose d'une semaine pour remettre en ordre les ratios.



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères en matière d'activités économiques durables sur la plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.investit.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

- En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?

L'indice de référence est un indice de marché large

- Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?

Moyenne 2022					
Durable obj. social sur 100%	ODD 3 Bonne santé	ODD 4 Education de qualité	ODD 5 Egalité des sexes	ODD 8 Travail décent	ODD 10 Réduction des inégalités
Portefeuille	1,37%	29,33%	22,92%	12,73%	25,26%
Indice de référence	1,25%	13,24%	17,42%	0,45%	11,09%
Durable obj. envi sur 100%	ODD 6 Eau propre	ODD 7 Energie propre	ODD 12 Consommation durable	ODD 13 Lutte contre le changement climatique	ODD 15 Biodiversité
Portefeuille	7,14%	38,83%	16,56%	18,35%	10,73%
Indice de référence	4,92%	1,62%	2,31%	9,48%	0,26%
Total moyenne 2022 :	Portefeuille	Indice de référence		Portefeuille	Indice de référence
Social	91,61%	43,44%	Proportion DNSH :	5,1%	7,7%
Environmental	91,61%	18,59%	Proportion Gouv :	4,9%	15,9%
Total :	91,61%	62,04%	Aucune contribution :	0,3%	13,4%
			Non durable	8,63%	37,80%

- Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Moyenne 2022					
Durable obj. social sur 100%	ODD 3 Bonne santé	ODD 4 Education de qualité	ODD 5 Egalité des sexes	ODD 8 Travail décent	ODD 10 Réduction des inégalités
Portefeuille	1,37%	29,33%	22,92%	12,73%	25,26%
Indice de référence	1,25%	13,24%	17,42%	0,45%	11,09%
Durable obj. envi sur 100%	ODD 6 Eau propre	ODD 7 Energie propre	ODD 12 Consommation durable	ODD 13 Lutte contre le changement climatique	ODD 15 Biodiversité
Portefeuille	7,14%	38,83%	16,56%	18,35%	10,73%
Indice de référence	4,92%	1,62%	2,31%	9,48%	0,26%
Total moyenne 2022 :	Portefeuille	Indice de référence		Portefeuille	Indice de référence
Social	91,61%	43,44%	Proportion DNSH :	5,1%	7,7%
Environmental	91,61%	18,59%	Proportion Gouv :	4,9%	15,9%
Total :	91,61%	62,04%	Aucune contribution :	0,3%	13,4%
			Non durable	8,63%	37,80%

- Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

L'indice de référence est un indice de marché large.