La Française LUX – Carbon Impact Income R (C) EUR

Pays d'enregistrement: LU FR

CHIFFRES CLÉS

Valeur liquidative : 102,52€

Actif sous gestion : 9,14M€

INDICATEUR SYNTHÉTIQUE DE RISQUE

1 2 **3** 4 5 6 7

Risque le plus faible — Risque le plus élevé

HORIZON DE PLACEMENT

1 an	2 ans	>3 ans	4 ans	5 ans

CARACTÉRISTIQUES

Forme juridique : Compartiment de la SICAV Luxembourgeoise La Française LUX

Date de création : 21/12/2016

Affectation des sommes distribuables : Capitalisation

Devise : EUR

Fréquence de Valorisation : Quotidienne

Type de clientèle : Tous souscripteurs

Risques principaux supportés : actions, change, crédit, dérivés, discrétionnaire, effet de levier, émergents, high yield, immobilier, perte en capital, taux

INFORMATIONS COMMERCIALES

Code ISIN : LU1523323860

Code Bloomberg : LFMAREC LX Equity

Centralisation : J avant 11H00

Règlement : J+2 ouvrés

Eligibilité au PEA : Non

Droits d'entrée max : 3%

Droits de sortie max : 0%

Frais de gestion et autres frais administratif et d'exploitation : 1.80% (31/12/2023)

Coûts de transaction : 0.66% (31/12/2023)

Dépositaire : BNP Paribas SA, Luxembourg Branch

Valorisateur : BNP Paribas SA, Luxembourg Branch

Société de gestion : La Française Asset Management

Gérant(s) : Gaël BINOT, Hervé CHATOT

STRATEGIE D'INVESTISSEMENT

L'objectif de ce Fonds est d'obtenir une croissance régulière du revenu et du capital à moyen et à long terme.
Le Fonds investit principalement en actions, obligations et valeurs immobilières sans distinction de lieu, y compris sur les marchés émergents.

PERFORMANCES NETTES

Les chiffres cités ont trait aux années écoulées, et les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. Ces performances ne tiennent pas compte des commissions et frais liés aux émissions et rachats de parts.

Cumulées	1 mois	3 mois	Année en cours	1 an	3 ans	5 ans	Création
Fonds	1,87%	2,87%	2,87%	8,19%	-3,73%	-2,39%	2,52%

Annualisées	3 ans	5 ans	Création
Fonds	-1,26%	-0,48%	0,34%

HISTORIQUE DES PERFORMANCES NETTES MENSUELLES

		Jan.	Fév.	Mar.	Avr.	Mai	Juin	Juil.	Aoû.	Sep.	Oct.	Nov.	Déc.	Année
2024	Fonds	0,07%	0,91%	1,87%										2,87%
2023	Fonds	2,93%	-2,33%	-0,51%	-0,02%	-0,97%	1,97%	1,03%	-0,89%	-2,17%	-1,33%	4,21%	3,42%	5,19%
2022	Fonds	-3,91%	-3,00%	0,67%	-3,44%	0,01%	-7,01%	3,60%	-1,47%	-5,73%	1,64%	5,53%	-0,15%	-13,15%
2021	Fonds	-0,72%	-0,23%	0,02%	1,64%	0,92%	0,63%	0,50%	1,02%	-2,50%	0,50%	-2,40%	2,21%	1,49%
2020	Fonds	-0,21%	-3,57%	-13,78%	3,89%	3,13%	2,20%	0,84%	1,64%	-1,45%	0,06%	5,70%	1,90%	-1,10%

EVOLUTION DE LA PERFORMANCE NETTE SUR 3 ANS

INDICATEURS DE PERFORMANCE

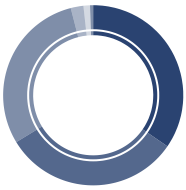
Fréquence hebdomadaire	1 an	3 ans	5 ans
Volatilité fonds	5,71%	7,38%	9,89%
Ratio de Sharpe	0,77	-0,38	-0,11
VaR histo (95%, 7 jours)	-1,06%	-1,69%	-1,67%

Sur 5 ans	
Gain Maximum	33,13% (23/03/2020 -> 06/09/2021)
Max. Drawdown	-23,95% (19/02/2020 -> 23/03/2020)
Recouvrement	442 jours (le 08/06/2021)

Document à destination des clients non professionnels et professionnels au sens de la Directive MIF2 - Document non contractuel - Avant toute souscription, prenez connaissance du prospectus disponible sur internet : www.la-francaise.com - Sources : La Française Asset Management, données comptables, Bloomberg

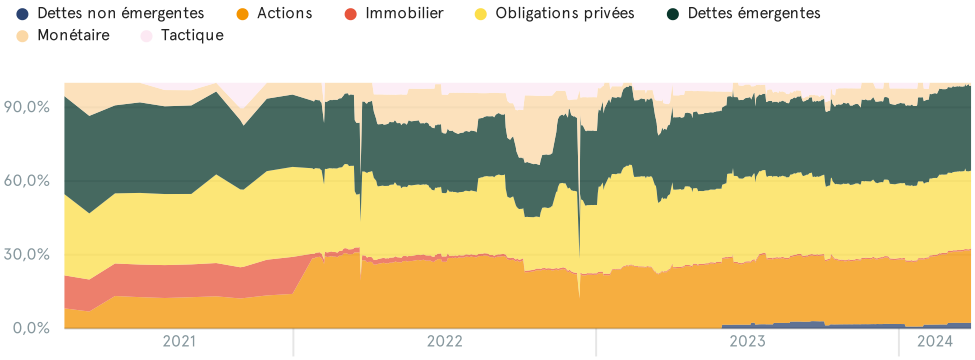
La Française LUX – Carbon Impact Income R (C) EUR

CLASSE D'ACTIF
En % exposition



Dettes émergentes	34,57%
Obligations privées	31,68%
Actions	29,67%
Dettes non émergentes	2,28%
Monétaire	1,17%
Immobilier	0,57%

EVOLUTION DE L'ALLOCATION
En % exposition



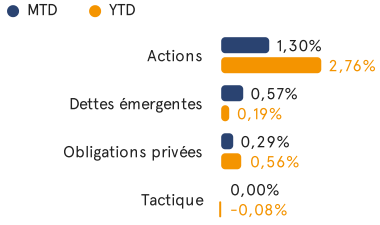
SECTEURS TAUX
En % actif (hors liquidités)

Etats	36,85%
Consommations non-cycliques	9,22%
Consommations Cycliques	6,98%
Communications	4,58%
Financières	3,58%
Services Publics	2,43%
Industrie	2,28%

SECTEUR ICB
En % actif (hors liquidités)

Technologie	8,05%
Industries	5,41%
Santé	3,82%
Consommation Discrétionnaire	3,17%
Sociétés Financières	3,00%
Biens de Consommation de Base	1,63%
Energie	1,43%
Services aux collectivités	1,25%
Matériaux de Base	0,97%
Télécommunications	0,95%
Immobilier	0,57%

CONTRIBUTION À LA PERFORMANCE
En % actif



ANALYSE DES RENDEMENTS
Hors monétaire

Rendement hors coût de couverture devise (hors	**4,63%**
Impact de la couverture devise	-0,74%

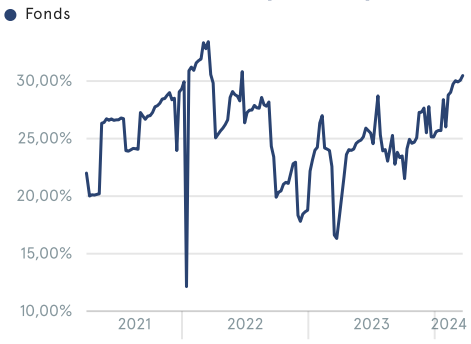
**Univers: 20% MSCI World Dividendes nets réinvestis (USD) + 40% JPM EM Bond Index Global Diversified ($) + 40% ICE BofA Global High Yield Index Total return*

PRINCIPALES LIGNES
Hors monétaire

Actions	Poids	Obligations	Poids
Caterpillar Inc	1,25%	Mexican 2,66 % 24/05/2031	4,03%
Qualcomm Inc	1,17%	Chile 2.55 % 27/01/2032	3,45%
Apple Computer Inc	0,96%	La Française Rendement Global 2028 Plus - Part :	2,60%
Johnson & Johnson	0,95%	Uruguay 4,38 % 23/01/2031	2,50%
Home Depot Inc	0,93%	Edf 7,500 % 31/12/2049	2,43%
Microsoft Corp	0,87%	Etat Français 0.500 % 25/06/2044	2,28%
American Express Co	0,69%	Indonesia Eur 3,75 % 14/06/2028	2,26%
Hsbc Holdings Plc	0,65%	Croatia 2,88 % 22/04/2032	2,21%
Bristol-myer Sqb	0,60%	Costa Rica 6.125 % 19/02/2031	2,07%
Paccar Inc	0,54%	Colombia 7.38 % 18/09/2037	2,03%

Nombre de titres en portefeuille: 154 **Poids des 10 principales lignes:** 25,86%

EXPOSITION ACTIONS (30.69%)

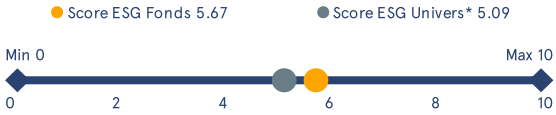


SENSIBILITÉ DU FONDS (3.66)

La Française LUX – Carbon Impact Income R (C) EUR

*Univers: 20% MSCI World Dividendes nets réinvestis (USD) + 40% JPM EM Bond Index Global Diversified ($) + 40% ICE BofA Global High Yield Index Total return

SCORES ESG, EMPREINTE CARBONE ET INTENSITÉ CARBONE



	Fonds	Univers*
Taux de couverture ESG	98,52%	97,78%
Score ESG	5,67	5,09
Score E	5,81	4,95
Score S	5,79	5,40
Score G	5,45	5,04
Taux de couverture Empreinte Carbon	97,60%	84,53%
Empreinte Carbone	67,75	71,52
Taux de couverture Intensité Carbone	98,50%	97,60%
Intensité Carbone	197,41	346,95

SCORE ESG PAR POCHE

Min 0 / Max 10

	Poche actions	Univers actions	Poche crédit	Univers crédit	Poche Etats	Univers Etats
Taux de couverture ESG	99,57%	99,71%	95,82%	94,92%	100,00%	99,68%
Score E	6,6	6,3	6,1	4,8	4,9	4,4
Score S	5,9	5,6	5,4	4,6	6,0	6,0
Score G	6,2	6,0	4,8	4,9	5,4	4,7
Score ESG	6,2	5,9	5,4	4,8	5,4	5,0

Univers de la poche action: MSCI World Dividendes nets réinvestis (USD)
Univers de la poche crédit : ICE BofA Global High Yield Index Total return
Univers de la poche Etats: JPM EM Bond Index Global Diversified ($)

PRINCIPAUX SCORES ESG

Min 0 / Max 10

POCHE ACTIONS

Meilleures notes	Poids	Score ESG
Applied Materials Inc	0,37%	7,88
Verbund Ag	0,12%	7,85
Abbott Laboratories	0,27%	7,77
Apple Computer Inc	0,96%	7,74
Cisco Systems Inc	0,53%	7,67

Moins bonnes notes	Poids	Score ESG
Caterpillar Inc	1,25%	4,55
Arch Capital Group Ltd	0,06%	4,74
Netapp Inc	0,42%	4,77
Hubbell Inc	0,26%	4,80
Manulife Financial Corp	0,24%	4,82

POCHE CRÉDIT

Meilleures notes	Poids	Score ESG
Banco Sabadell	1,19%	6,95
IMPREGILO	1,21%	6,76
TEVA PHARM FNC NL II	1,22%	6,56
EDF	2,43%	6,55
Organon & Co/Organon Foreign Debt	1,03%	6,24

Moins bonnes notes	Poids	Score ESG
Iliad Sa	1,13%	4,57
Gamenet Group Spa	1,19%	4,64
LORCA TELECOM BONDCO	1,07%	4,66
Cirsa Finance International SARL	1,17%	4,89
GRUENENTHAL GMBH	1,09%	5,00

POCHE ETATS

Meilleures notes	Poids	Score ESG
Etat Français	2,28%	6,46
Etat Chilien	3,45%	6,45
Etat Croate	2,21%	6,40
Etat Hongrois	0,95%	6,38
Etat Uruguayen	2,50%	6,35

Moins bonnes notes	Poids	Score ESG
Etat Ivoirien	0,96%	3,84
Etat Equatorien	1,08%	4,34
Etat Indonésien	4,23%	4,65
Etat Mexicain	4,45%	4,71
Etat Colombien	2,03%	4,83

DÉFINITIONS DES TERMES EXTRA-FINANCIERS

Score ESG : le process ESG consiste en une exclusion de 20% de l'univers suivie d'une analyse financière et carbone des entreprises afin de déterminer leur éligibilité au portefeuille. Plus d'informations peuvent être trouvées dans le prospectus et le code de transparence du fonds. Le score ESG mesure la qualité ESG globale d'une entreprise. Il est calculé comme une moyenne pondérée des trois scores factoriels (Durabilité Environnementale, Capital Humain et Capital Organisationnel), en utilisant des pondérations sectorielles. Le score ESG de l'univers d'investissement est automatisé et permet des ajustements afin de refléter les informations complémentaires dont disposent les analystes ESG, le cas échéant.

Score Environnement: Le premier facteur du modèle ESG d'Inflection Point évalue les performances des entreprises et les stratégies de réduction des impacts environnementaux dans leurs activités et leur chaîne de valeur.

Score Social : le deuxième facteur du modèle ESG évalue les politiques, programmes et performances des entreprises en matière de gestion et de développement de leurs effectifs.

Score Gouvernance: le troisième facteur du modèle ESG évalue la qualité des pratiques de gouvernance d'entreprise des entreprises et de leur gestion des relations avec les parties prenantes (par exemple, les fournisseurs).

Score Carbon Impact : Le score Carbon Impact est calculé comme étant la moyenne d'indicateurs pour chaque catégorie du TCFD (Task Force on Climate-Related Financial Disclosures) au niveau des entreprises, et peut être ajusté afin de refléter les informations complémentaires dont disposent les analystes ESG, le cas échéant.

Intensité Carbone : L'intensité carbone d'une entreprise est calculée comme étant le ratio entre le volume des émissions de gaz à effet de serre (GHG) de l'entreprise en tonnes de CO2eq et le chiffre d'affaires.

Empreinte Carbone: l'empreinte carbone est un indicateur des émissions de CO2 générées par les compagnies détenues dans notre portefeuille. Les données CO2 sont fournies par La Française en s'appuyant majoritairement sur une source CDP. Elles capturent les scopes 1 et 2. La formule de calcul est la suivante: Σ (i à n) (investissement i / Enterprise value) / (Valeur du portefeuille) × Emissions de l'émetteur i

La Française LUX – Carbon Impact Income R (C) EUR

AVERTISSEMENT

Les informations contenues dans ce document ne constituent en aucun cas une offre ou une sollicitation d'investir, ni un conseil en investissement ou une recommandation sur des investissements spécifiques. Les données chiffrées n'ont pas de valeur contractuelle et sont sujettes à modification.
Ceci est un document publicitaire. Le pays d'origine du fonds est le Luxembourg.
Les informations sur le fonds, dont les calculs de la performance et les autres données, sont fournies par la société de gestion à la date du document.
En fonction de la stratégie du fonds, des données dites « internes » peuvent être différentes de celles mentionnées dans le prospectus. Les données internes n'engagent pas la Société de Gestion qui demeure libre de les faire évoluer sans préavis dans les limites du prospectus qui seul fait foi. La Société de Gestion entend par « données internes » un ensemble d'éléments tels que : limites de gestion internes, analyses économiques, commentaires des gérants. Cette liste n'est pas limitative.
Les notations Morningstar et/ou Lipper sont soumises à copyright. Tous droits réservés. Les informations présentées : (1) appartiennent à Morningstar et/ou Lipper et/ou à leurs fournisseurs d'informations (2) ne peuvent être ni reproduites, ni redistribuées (3) sont présentées sans garantie d'exactitude, d'exhaustivité ou d'actualité.
Il est rappelé que les performances passées ne préjugent pas des performances futures et ne sont pas constantes dans le temps. Compte tenu des risques d'ordre économique et financier, il ne peut être donné aucune assurance que le fonds présenté atteindra son objectif.
La documentation commerciale et réglementaire (dont le prospectus de chaque fonds) est disponible, en anglais, sur le site du Groupe La Française (www.la-francaise.com) et/ou sur simple demande auprès de votre interlocuteur financier habituel.
Document édité par La Française AM Finance Services, 128, boulevard Raspail, 75006 Paris, France, société régulée par l'"Autorité de Contrôle Prudentiel" (www.acp.banque-france.fr), sous la référence 18673 X.

Ce document est confidentiel, à usage strictement privé et destiné uniquement à l'information de la personne à laquelle il a été remis par le Groupe La Française. Aucune diffusion des informations contenues dans cette présentation n'est autorisée sous quelque forme que ce soit sans l'accord préalable écrit du Groupe La Française. Les noms, logos ou slogans identifiant les produits ou services du Groupe La Française sont la propriété exclusive de celui-ci et ne peuvent être utilisés de quelque manière que ce soit sans l'accord préalable écrit du Groupe La Française.

Information importante pour les investisseurs en Allemagne
Agent d'information et agent payeur : BNP PARIBAS Securities Services S.A. – Zweigniederlassung Frankfurt am Main, Europa-Allee 12, 60327 Frankfurt am Main

Information importante pour les investisseurs en Espagne
Représentant local : Allfunds Bank SA Calle Estafeta 6 - Complejo Plaza de la Fuente, Edificio 3, La Moraleja, Espagne

Information importante pour les investisseurs en Italie
Distributeur local : BNP PARIBAS Securities Services, Via Ansperto no. 5 20123 Milan, Italie

Information importante pour les investisseurs au Royaume-Uni
Agent d'information et Agent payeur : BNP Paribas Securities Services London, 5 Moorgate, London, EC2R 6PA United Kingdom

Information importante pour les investisseurs en Suisse
Représentant local: ACOLIN Fund Services AG, Leutschenbachstrasse 50, CH-8050 Zurich et Agent Payeur local: NPB Neue Privat Bank AG, Limmatquai 1/am Bellevue, P.O.Box, CH-8024 Zurich. Le prospectus, les feuilles d'information de base, le règlement, les rapports Annuel et semestriel peuvent être obtenus gratuitement auprès du représentant. Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et frais perçus lors de l'émission et du rachat des parts.

Information importante pour les investisseurs à Singapour
Le fonds est non autorisé en vertu de l'article 286 du Securities and Futures Act (Cap. 289) («SFA») ou reconnu en vertu de l'article 287 du SFA, et le Fonds n'est pas autorisé à être proposé au public. Ce matériel et tout autre document émis dans le cadre de l'offre ou de la vente de Parts ne sont pas un prospectus tel que défini dans le SFA et ne seront pas déposés ou enregistrés en tant que prospectus auprès de l'Autorité Monétaire de Singapour. La responsabilité légale en vertu du SFA en ce qui concerne le contenu des prospectus ne s'applique pas. Aucune offre ou invitation de souscription ou d'achat des parts, ne peut être faite, ni aucun document ou autre matériel (y compris, mais sans s'y limiter, ce matériel) relatif au Fonds ne peut être diffusé ou distribué, directement ou indirectement, à toute personne à Singapour autre qu'un investisseur institutionnel (tel que défini à l'article 4A du SFA) conformément à l'article 304 du SFA. Lorsqu'une offre est faite à des investisseurs institutionnels conformément à l'article 304 du SFA, certaines restrictions peuvent s'appliquer aux actions acquises dans le cadre d'une telle offre.

Gérant : Équipe de gestion actuelle, susceptible d'évoluer dans le temps.