



Ce rapport présente une série de résultats relatifs aux caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance (ESG) du fonds. Ces dimensions sont analysées selon les thèmes et critères suivants :

| 3 piliers | 10 thèmes | 35 critères dont : |
|---------------|----------------------------------|--|
| Environnement | Changement climatique | Emissions carbonées, vulnérabilité au changement climatique, empreinte carbone des produits |
| | Ressources naturelles | Stress hydrique, matières premières, biodiversité |
| | Pollution et déchets | Emission toxique et déchet, déchets électroniques, déchets d'emballage |
| Social | Opportunités environnementales | Bâtiments verts, technologie verte, énergie renouvelable |
| | Capital humain | Santé et sûreté au travail, gestion du travail, développement du capital humain |
| Gouvernance | Responsabilité des produits | Qualité et sûreté des produits, sécurité des données, investissement responsable |
| | Opposition des parties prenantes | Approvisionnement controversé |
| | Opportunités sociales | Accès aux services de communication, accès aux services de santé, accès aux services de la finance |
| Gouvernance | Gouvernance d'entreprise | Conseil d'administration, rémunération, structure, comptabilité |
| | Comportement des entreprises | Ethique des affaires, corruption et instabilité, transparence fiscale |

INDICATEURS

Afin d'évaluer chacune des composantes indépendamment, les notations issues de la recherche MSCI sont utilisées. La performance générale est appréciée grâce aux notes globales, pondérées et ajustées. Les notes ajustées permettent de comparer différents secteurs entre eux. L'impact carbone est également calculé à partir de données fournies par MSCI.

APPROCHE ESG Best in Universe/Score ESG

Ce filtre permet de sélectionner tous les acteurs de l'univers d'investissement. Toutefois le score ESG du portefeuille devra à tout moment être supérieur au score ESG de l'univers d'investissement après élimination des 20% de plus mauvaises valeurs en ESG. La sélectivité sera réalisée en poids de l'actif.

L'indice de couverture du portefeuille doit être de 90% minimum pour le score ESG et l'indicateur d'impact environnemental. Concernant l'indicateur d'impact de gouvernance le taux de couverture s'établit à 70%. Concernant ces indicateurs d'impact, le portefeuille doit surperformer son benchmark / univers sans le retraitement des 20% plus mauvaises notes. À l'image des autres approches ISR, 90% des fonds détenus par un fonds doivent avoir le label ISR.

INDICE DE REFERENCE

-

Couverture par un score ESG *

| 31/12/2021 | Portefeuille | Indice |
|------------|--------------|--------|
| | 97.3% | - |

* En pourcentage de l'actif net, hors liquidités

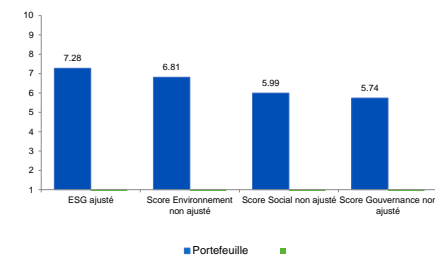
Intensité carbone * (en tonnes de CO2 par million de dollars US de revenus)

| 31/12/2021 | Portefeuille | Indice | Relatif |
|------------|--------------|--------|---------|
| Total | 157.6 | - | - |

* y compris souverains

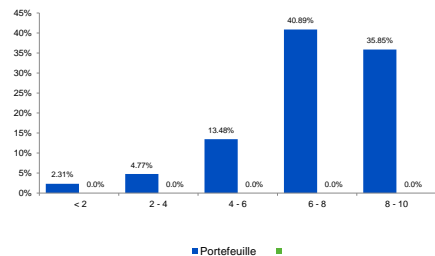
Source : BRS & MSCI au 31/12/2021

Scores ESG



Source : BRS & MSCI au 31/12/2021

Répartition par score ESG (rebasé à 100)



Source : BRS & MSCI au 31/12/2021

Top 10 émetteurs : score ESG

| Emetteur | Poids | Score |
|------------------------------------|--------------|-------|
| DIAGEO FINANCE PLC | 0.16% | 10.0 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA | 1.47% | 10.0 |
| BANK OF NOVA SCOTIA | 0.21% | 10.0 |
| COVIVIO SA | 0.11% | 10.0 |
| CRH FINANCE DAC | 0.03% | 10.0 |
| EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 0.23% | 10.0 |
| EDP FINANCE BV | 0.10% | 10.0 |
| KBC GROEP NV | 1.17% | 10.0 |
| KELLOGG COMPANY | 0.12% | 10.0 |
| KLEPIERRE SA | 0.26% | 10.0 |
| Total | 3.86% | |

Source : BRS & MSCI au 31/12/2021

Bottom 10 émetteurs : score ESG

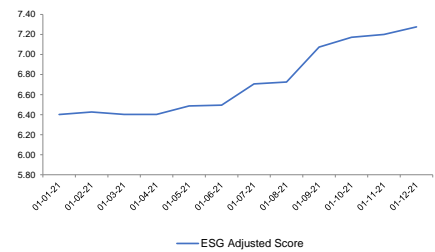
| Emetteur | Poids | Score |
|---|--------------|-------|
| ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE LTD | 0.02% | 0.0 |
| CHINA MERCHANTS FINANCE CO LTD | 0.00% | 0.0 |
| CHINA MODERN DAIRY HOLDINGS LTD | 0.00% | 0.0 |
| CHINA TAIPING CAPITAL LTD | 0.00% | 0.0 |
| CMHI FINANCE (BVI) CO LTD | 0.00% | 0.0 |
| DONGXING VOYAGE CO LTD | 0.00% | 0.0 |
| HPCL-MITTAL ENERGY LTD | 0.00% | 0.0 |
| JOLIBEE WORLDWIDE PTE LTD | 0.01% | 0.0 |
| KOREA SOUTH-EAST POWER CO LTD | 0.00% | 0.0 |
| MCC HOLDING (HONG KONG) CORP LTD | 0.00% | 0.0 |
| Total | 0.04% | |

Source : BRS & MSCI au 31/12/2021

| 30/09/2021 | Portefeuille | Indice |
|------------|--------------|--------|
| | 97.8% | - |

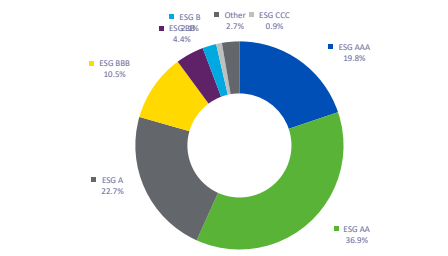
| 30/09/2021 | Portefeuille | Indice | Relatif |
|------------|--------------|--------|---------|
| Total | 169.6 | - | - |

Evolution du score ESG relatif



Source : BRS & MSCI au 31/12/2021

Répartition des notations ESG



Source : BRS & MSCI au 31/12/2021

Top 10 émetteurs : intensité carbone

| Emetteur | Poids | Intensité carbone |
|--|--------------|-------------------|
| MOLNLYCKE HOLDING AB | 0.12% | 0.0 |
| TERRAFORM GLOBAL OPERATING LP | 0.00% | 0.0 |
| CNP ASSURANCES | 0.44% | 0.1 |
| RONSHINE CHINA HOLDINGS LTD | 0.00% | 0.1 |
| NATIONALE NEDERLANDEN BANK N V | 0.19% | 0.2 |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB | 0.06% | 0.2 |
| ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD | 0.00% | 0.2 |
| ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD | 0.00% | 0.2 |
| INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD | 0.01% | 0.3 |
| INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD (I | 0.00% | 0.3 |
| Total | 0.83% | |

Source : BRS & MSCI au 31/12/2021

Bottom 10 émetteurs : intensité carbone

| Emetteur | Poids | Intensité carbone |
|---|--------------|-------------------|
| NTPC LTD | 0.01% | 17 342.2 |
| ABU DHABI NATIONAL ENERGY COMPANY PJSC | 0.04% | 12 079.0 |
| EMIRATES SEMB CORP WATER AND POWER COMPAN | 0.00% | 12 079.0 |
| RUWAIS POWER COMPANY PJSC | 0.01% | 12 079.0 |
| SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKUK CO | 0.01% | 11 001.8 |
| SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKUK CO 5 | 0.01% | 11 001.8 |
| SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKUK COMPANY 4 | 0.01% | 11 001.8 |
| SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKUK COMPANY 3 | 0.02% | 11 001.8 |
| KOREA SOUTH-EAST POWER CO LTD | 0.00% | 10 867.3 |
| PHOENIX LEAD LTD | 0.00% | 10 713.8 |
| Total | 0.12% | |

Source : BRS & MSCI au 31/12/2021

Information importante

Ce document est établi par Abelle Asset Management, société de gestion de portefeuille de droit français agréée par l'Autorité des Marchés Financiers (AMF) sous le n° GP 97-114, Société Anonyme à Directoire et Conseil de Surveillance au capital de 18.608.050 euros, immatriculée au Registre du Commerce et des Sociétés de Paris sous le numéro 335 133 229. Il contient des éléments d'information et des données chiffrées qu'Abelle Asset Management considère comme fondés ou exacts au jour de leur établissement. Pour ceux de ces éléments qui proviennent de sources d'information externes, leur exactitude ne saurait être garantie. Ce document est exclusivement conçu à des fins d'information. Il ne saurait être assimilé à une activité de démarchage, à une quelconque offre de valeur mobilière ou instrument financier que ce soit ou de recommandation d'en acheter ou d'en vendre. La distribution et l'offre d'actions ou de parts de l'OPC cité peuvent être limitées ou interdites par la loi dans certaines juridictions. Ce document ne donne aucune assurance de l'adéquation de l'OPC à la situation financière, au profil de l'investisseur. Avant d'investir dans ce fonds, l'investisseur doit procéder à sa propre analyse en s'appuyant sur les conseils de son choix. Abelle Asset Management décline toute responsabilité quant à d'éventuels dommages ou pertes résultant de l'utilisation en tout ou partie des éléments figurant dans ce document. Le prospectus, le DICI, ainsi que les derniers états financiers disponibles, sont à la disposition du public sur simple demande, auprès d'Abelle Asset Management. Ce document ne peut être reproduit sous quelque forme que ce soit ou transmis à une autre personne que celle à qui il est adressé. Le 22 novembre 2021, Aviva Investors France change de nom et devient Abelle Asset Management. Ce changement de dénomination sociale s'inscrit dans le cadre de l'intégration des entités du Groupe Aviva à Aéma Groupe à la suite de la cession des activités françaises du Groupe Aviva plc à Aéma Groupe en date du 30 septembre 2021. Abelle Asset Management n'appartenant plus au groupe Aviva plc, elle ne saurait être tenue responsable des publications effectuées par Aviva plc et ses filiales sur le territoire français.



Ce rapport présente une série de résultats relatifs aux caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance (ESG) du fonds. Ces dimensions sont analysées selon les thèmes et critères suivants :

| 3 piliers | 10 thèmes | 35 critères dont : |
|--------------------------------|--|---|
| Environnement | Changement climatique | Emissions carbonées, vulnérabilité au changement climatique, empreinte carbone des produits |
| | Ressources naturelles | Stress hydrique, matières premières, biodiversité |
| | Pollution et déchets | Emission toxique et déchet, déchets électroniques, déchets d'emballage |
| Opportunités environnementales | Bâtiments verts, technologie verte, énergie renouvelable | |

| | |
|----------------------------------|--|
| Capital humain | Santé et sécurité au travail, gestion du travail, développement du capital humain |
| Responsabilité des produits | Qualité et sécurité des produits, sécurité des données, investissement responsable |
| Opposition des parties prenantes | Approvisionnement controversé |
| Opportunités sociales | Accès aux services de communication, accès aux services de santé, accès aux services de la finance |

| | |
|------------------------------|---|
| Gouvernance d'entreprise | Conseil d'administration, rémunération, structure, comptabilité |
| Comportement des entreprises | Ethique des affaires, corruption et instabilité, transparence fiscale |

INDICATEURS

Afin d'évaluer chacune des composantes indépendamment, les notations issues de la recherche MSCI sont utilisées. La performance générale est appréciée grâce aux notes globales, pondérées et ajustées. Les notes ajustées permettent de comparer différents secteurs entre eux. L'impact carbone est également calculé à partir de données fournies par MSCI.

APPROCHE ESG Best in Universe/Score ESG

Ce filtre permet de sélectionner tous les acteurs de l'univers d'investissement. Toutefois le score ESG du portefeuille devra à tout moment être supérieur au score ESG de l'univers d'investissement après élimination des 20% de plus mauvaises valeurs en ESG. La sélectivité sera réalisée en poids de l'actif. L'indice de couverture du portefeuille doit être de 90% minimum pour le score ESG et l'indicateur d'impact environnemental. Concernant l'indicateur d'impact de gouvernance le taux de couverture s'élevait à 70%. Concernant ces indicateurs d'impact, le portefeuille doit surperformer son benchmark / univers sans le retraitement des 20% plus mauvaises notes. A l'image des autres approches ISR, 90% des fonds détenus par un fonds doivent avoir le label ISR.

INDICE DE REFERENCE

-

Exemples de critères d'indicateurs d'impact

| Environnement | | | | | | Intensité carbone (en tonnes de CO2 par million de dollars US de PIB) | | | | | |
|---------------------------------|--------|--------------|--------------------|---------------|--------|---|--------|--------------|--------------------|---------------|--------|
| 31/12/2021 | | | Taux de Couverture | | | 31/12/2020 | | | Taux de Couverture | | |
| Score | | % d'encours | | % d'émetteurs | | Score | | % d'encours | | % d'émetteurs | |
| Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice |
| 341.1 | - | 99.3% | 99.3% | 366.3% | - | 401.1 | - | 93.7% | 93.7% | 0.0% | - |
| 0.0% | | | | | | 0.0% | | | | | |
| Relatif depuis le début d'année | | | | | | Relatif depuis le début d'année | | | | | |
| -60.0 | | - | | 5.6% | | 366.3% | | - | | - | |

| Social | | | | | | Indice de Gini | | | | | |
|---------------------------------|--------|--------------|--------------------|---------------|--------|---------------------------------|--------|--------------|--------------------|---------------|--------|
| 31/12/2021 | | | Taux de Couverture | | | 31/12/2020 | | | Taux de Couverture | | |
| Score | | % d'encours | | % d'émetteurs | | Score | | % d'encours | | % d'émetteurs | |
| Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Relatif depuis le début d'année | | | | | | Relatif depuis le début d'année | | | | | |
| - | | - | | - | | - | | - | | - | |

| Gouvernance | | | | | | Indice de Perception de la Corruption | | | | | |
|---------------------------------|--------|--------------|--------------------|---------------|--------|---------------------------------------|--------|--------------|--------------------|---------------|--------|
| 31/12/2021 | | | Taux de Couverture | | | 31/12/2020 | | | Taux de Couverture | | |
| Score | | % d'encours | | % d'émetteurs | | Score | | % d'encours | | % d'émetteurs | |
| Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Relatif depuis le début d'année | | | | | | Relatif depuis le début d'année | | | | | |
| - | | - | | - | | - | | - | | - | |

| Droits humains | | | | | | Inégalité des genres | | | | | |
|---------------------------------|--------|--------------|--------------------|---------------|--------|---------------------------------|--------|--------------|--------------------|---------------|--------|
| 31/12/2021 | | | Taux de Couverture | | | 31/12/2020 | | | Taux de Couverture | | |
| Score | | % d'encours | | % d'émetteurs | | Score | | % d'encours | | % d'émetteurs | |
| Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice |
| 99.2 | - | 100.0% | - | 366.3% | - | 90.0 | - | 35.6% | - | 0.0% | - |
| Relatif depuis le début d'année | | | | | | Relatif depuis le début d'année | | | | | |
| 9.2 | | #VALEUR! | | 171.0% | | - | | 366.3% | | - | |

Source : BRS & MSCI au 31/12/2021

Glossaire

Couverture par un score ESG

Score ESG (ajusté) : La meilleure entreprise d'un secteur se voit attribuer le score de 10 et la pire le score de 0. Une distribution normale est appliquée pour les autres entreprises. Ce score permet donc de comparer la position ESG des entreprises entre différents secteurs. Source : MSCI ESG

Score Environnement : Ce score représente la moyenne pondérée des scores relatifs aux problématiques du pilier Environnement, allant de 0 (pire) à 10 (meilleur). Source : MSCI ESG

Score Social : Ce score représente la moyenne pondérée des scores relatifs aux problématiques du pilier Social, allant de 0 (pire) à 10 (meilleur). Source : MSCI ESG

Score Gouvernance : Ce score représente la moyenne pondérée des scores relatifs aux problématiques du pilier Gouvernance, allant de 0 (pire) à 10 (meilleur). Source : MSCI ESG

Intensité carbone

Ce chiffre représente le total des émissions carbone engendrées par les entreprises détenues dans le portefeuille (exprimées en tonnes d'équivalent CO2), par million de USD de chiffre d'affaires. Pour calculer les émissions carbone de l'entreprise nous utilisons les émissions du Scope 1 (émissions directes induites par la combustion d'énergie fossile) et du Scope 2 (émissions indirectes induites par l'achat ou la production d'électricité). Ainsi, pour chaque million de dollars de chiffre d'affaire, les entreprises du portefeuille émettent X tonnes d'équivalent CO2.

Indicateurs d'impact

Intensité carbone : cf ci-dessus

Pourcentage moyen des employés représentés par une convention collective : Il représente le pourcentage moyen des employés représentés par une convention collective parmi les sociétés du portefeuille. La mise à jour des données est annuelle. Source : MSCI ESG

Pourcentage d'indépendance du conseil d'administration : Il représente le pourcentage moyen d'indépendance du conseil d'administration parmi les sociétés du portefeuille. La mise à jour des données est annuelle. Source : MSCI ESG

Pourcentage d'émetteurs respectant les principes du Pacte mondial des Nations Unies : Il représente le pourcentage moyen des entreprises qui sont en ligne avec les 10 principes du Pacte mondial des Nations Unies relatifs au respect des droits humains, aux normes internationales du travail, à l'environnement et à la lutte contre la corruption. Source : MSCI ESG

Information importante

Ce document est établi par Abelle Asset Management, société de gestion de portefeuille de droit français agréée par l'Autorité des Marchés Financiers (AMF) sous le n° GP 97-114. Société Anonyme à Directoire et Conseil de Surveillance au capital de 19.608.050 euros, immatriculée au Registre du Commerce et des Sociétés de Paris sous le numéro 335 133 229. Il contient des éléments d'information et des données chiffrées qu'Abelle Asset Management considère comme fondés ou exacts au jour de leur établissement. Pour ceux de ces éléments qui proviennent de sources d'information externes, leur exactitude ne saurait être garantie. Ce document est exclusivement conçu à des fins d'information. Il ne saurait être assimilé à une activité de démarchage, à une quelconque offre de valeur mobilière ou instrument financier que ce soit ou de recommandation d'en acheter ou d'en vendre. La distribution et l'offre d'actions ou de parts de l'OPC cité peuvent être limitées ou interdites par la loi dans certaines juridictions. Ce document ne donne aucune assurance de l'adéquation de l'OPC à la situation financière, au profil de risque, à l'expérience ou aux objectifs de l'investisseur. Avant d'investir dans ce fonds, l'investisseur doit procéder à sa propre analyse en s'appuyant sur les conseils de son choix. Abelle Asset Management décline toute responsabilité quant à d'éventuels dommages ou pertes résultant de l'utilisation en tout ou partie des éléments figurant dans ce document. Le prospectus, le DICI, ainsi que les derniers états financiers disponibles, sont à la disposition du public sur simple demande, auprès d'Abelle Asset Management. Ce document ne peut être reproduit sous quelque forme que ce soit ou transmis à une autre personne que celle à qui il est adressé. Le 22 novembre 2021, Aviva Investors France change de nom et devient Abelle Asset Management. Ce changement de dénomination sociale s'inscrit dans le cadre de l'intégration des entités du Groupe Aviva à Aéma Groupe à la suite de la cession des activités françaises du Groupe Aviva plc à Aéma Groupe en date du 30 septembre 2021. Abelle Asset Management n'appartenant plus au groupe Aviva plc, elle ne saurait être tenue responsable des publications effectuées par Aviva plc et ses filiales sur le territoire français.



Ce rapport présente une série de résultats relatifs aux caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance (ESG) du fonds. Ces dimensions sont analysées selon les thèmes et critères suivants :

| 3 piliers | 10 thèmes | 35 critères dont : |
|---------------|----------------------------------|--|
| Environnement | Changement climatique | Emissions carbonées, vulnérabilité au changement climatique, empreinte carbone des produits |
| | Ressources naturelles | Stress hydrique, matières premières, biodiversité |
| | Pollution et déchets | Emission toxique et déchet, déchets électroniques, déchets d'emballage |
| Social | Opportunités environnementales | Bâtiments verts, technologie verte, énergie renouvelable |
| | Capital humain | Santé et sûreté au travail, gestion du travail, développement du capital humain |
| Gouvernance | Responsabilité des produits | Qualité et sûreté des produits, sécurité des données, investissement responsable |
| | Opposition des parties prenantes | Approvisionnement controversé |
| | Opportunités sociales | Accès aux services de communication, accès aux services de santé, accès aux services de la finance |
| Gouvernance | Gouvernance d'entreprise | Conseil d'administration, rémunération, structure, comptabilité |
| | Comportement des entreprises | Ethique des affaires, corruption et instabilité, transparence fiscale |

■ Exemples de critères d'indicateurs d'impact

| Environnement | | Intensité carbone (en tonnes de CO2 par million de dollars US de chiffre d'affaires) | | | | | | | | | |
|--|--------|--|--------|---------------|--------|--------------|--------|--------------------|--------|---------------|--------|
| 31/12/2021 | | Taux de Couverture | | | | 31/12/2020 | | Taux de Couverture | | | |
| Score | | % d'encours | | % d'émetteurs | | Score | | % d'encours | | % d'émetteurs | |
| Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice |
| 97.1 | - | 93.6% | 93.6% | 156.1% | - | 113.3 | 0.0 | 75.7% | 75.7% | 0.0% | - |
| | | 0.0% | | | | 113.3 | | 0.0% | | | |
| Relatif depuis le début d'année | | | | | | | | | | | |
| -16.2 | | -18.0% | | 18.0% | | 156.1% | | - | | - | |

| Social | | Pourcentage d'employés représentés par une convention collective | | | | | | | | | |
|--|--------|--|--------|---------------|--------|--------------|--------|--------------------|--------|---------------|--------|
| 31/12/2021 | | Taux de Couverture | | | | 31/12/2020 | | Taux de Couverture | | | |
| Score | | % d'encours | | % d'émetteurs | | Score | | % d'encours | | % d'émetteurs | |
| Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice |
| 63.0 | - | 92.0% | 70.2% | 87.1% | - | 60.5 | - | 72.5% | 53.6% | 38.7% | 0.0% |
| | | 21.7% | | | | | | 18.9% | | 38.7% | |
| Relatif depuis le début d'année | | | | | | | | | | | |
| 2.5 | | -19.4% | | 16.6% | | 48.3% | | - | | - | |

| Gouvernance | | Pourcentage de membres indépendants du conseil d'administration | | | | | | | | | |
|--|--------|---|--------|---------------|--------|--------------|--------|--------------------|--------|---------------|--------|
| 31/12/2021 | | Taux de Couverture | | | | 31/12/2020 | | Taux de Couverture | | | |
| Score | | % d'encours | | % d'émetteurs | | Score | | % d'encours | | % d'émetteurs | |
| Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice |
| 81.5 | - | 58.1% | - | 75.6% | - | 78.1 | - | 109.6% | 0.0% | 0.0% | - |
| | | | | | | | | 109.6% | | | |
| Relatif depuis le début d'année | | | | | | | | | | | |
| 3.4 | | -51.5% | | 75.6% | | - | | - | | - | |

| Droits humains | | Pourcentage moyen des émetteurs respectant les principes du Pacte mondial de l'ONU | | | | | | | | | |
|--|--------|--|--------|---------------|--------|--------------|--------|--------------------|--------|---------------|--------|
| 31/12/2021 | | Taux de Couverture | | | | 31/12/2020 | | Taux de Couverture | | | |
| Score | | % d'encours | | % d'émetteurs | | Score | | % d'encours | | % d'émetteurs | |
| Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice | Portefeuille | Indice |
| 99.9 | - | 100.0% | - | 100.0% | - | 98.7 | - | 92.7% | 0.0% | 0.0% | - |
| | | | | | | | | | | | |
| Relatif depuis le début d'année | | | | | | | | | | | |

Source : BRS & MSCI au 31/12/2021

Glossaire

■ Couverture par un score ESG

Score ESG (ajusté) : La meilleure entreprise d'un secteur se voit attribuer le score de 10 et la pire le score de 0. Une distribution normale est appliquée pour les autres entreprises. Ce score permet donc de comparer la position ESG des entreprises entre différents secteurs. Source : MSCI ESG

Score Environnement : Ce score représente la moyenne pondérée des scores relatifs aux problématiques du pilier Environnement, allant de 0 (pire) à 10 (meilleur). Source : MSCI ESG

Score Social : Ce score représente la moyenne pondérée des scores relatifs aux problématiques du pilier Social, allant de 0 (pire) à 10 (meilleur). Source : MSCI ESG

Score Gouvernance : Ce score représente la moyenne pondérée des scores relatifs aux problématiques du pilier Gouvernance, allant de 0 (pire) à 10 (meilleur). Source : MSCI ESG

■ Intensité carbone

Ce chiffre représente le total des émissions carbone engendrées par les entreprises détenues dans le portefeuille (exprimées en tonnes d'équivalent CO2), par million de USD de chiffre d'affaires. Pour calculer les émissions carbone de l'entreprise nous utilisons les émissions du Scope 1 (émissions directes induites par la combustion d'énergie fossile) et du Scope 2 (émissions indirectes induites par l'achat ou la production d'électricité). Ainsi, pour chaque million de dollars de chiffre d'affaire, les entreprises du portefeuille émettent X tonnes d'équivalent CO2.

■ Indicateurs d'impact

Intensité carbone : cf ci-dessus

Pourcentage moyen des employés représentés par une convention collective : Il représente le pourcentage moyen des employés représentés par une convention collective parmi les sociétés du portefeuille. La mise à jour des données est annuelle. Source : MSCI ESG

Pourcentage d'indépendance du conseil d'administration : Il représente le pourcentage moyen d'indépendance du conseil d'administration parmi les sociétés du portefeuille. La mise à jour des données est annuelle. Source : MSCI ESG

Pourcentage d'émetteurs respectant les principes du Pacte mondial des Nations Unies : Il représente le pourcentage moyen des entreprises qui sont en ligne avec les 10 principes du Pacte mondial des Nations Unies relatifs au respect des droits humains, aux normes internationales du travail, à l'environnement et à la lutte contre la corruption. Source : MSCI ESG

INDICATEURS

Afin d'évaluer chacune des composantes indépendamment, les notations issues de la recherche MSCI sont utilisées. La performance générale est appréciée grâce aux notes globales, pondérées et ajustées. Les notes ajustées permettent de comparer différents secteurs entre eux. L'impact carbone est également calculé à partir de données fournies par MSCI.

APPROCHE ESG Best in Universe/Score ESG

Ce filtre permet de sélectionner tous les acteurs de l'univers d'investissement. Toutefois le score ESG du portefeuille devra à tout moment être supérieur au score ESG de l'univers d'investissement après élimination des 20% de plus mauvaises valeurs en ESG. La sélectivité sera réalisée en poids de l'actif. L'indice de couverture du portefeuille doit être de 90% minimum pour le score ESG et l'indicateur d'impact environnemental. Concernant l'indicateur d'impact de gouvernance le taux de couverture s'établit à 70%. Concernant ces indicateurs d'impact, le portefeuille doit surperformer son benchmark / univers sans le retraitement des 20% plus mauvaises notes. A l'image des autres approches ISR, 90% des fonds détenus par un fonds doivent avoir le label ISR.

INDICE DE REFERENCE

-

Information importante

Ce document est établi par Abellie Asset Management, société de gestion de portefeuille de droit français agréée par l'Autorité des Marchés Financiers (AMF) sous le n° GP 97-114. Société Anonyme à Directoire et Conseil de Surveillance au capital de 18.608.050 euros, immatriculée au Registre du Commerce et des Sociétés de Paris sous le numéro 335 133 229. Il contient des éléments d'information et des données chiffrées qu'Abellie Asset Management considère comme fondés ou exacts au jour de leur établissement. Pour ceux de ces éléments qui proviennent de sources d'information externes, leur exactitude ne saurait être garantie. Ce document est exclusivement conçu à des fins d'information. Il ne saurait être assimilé à une activité de démarchage, à une quelconque offre de valeur mobilière ou instrument financier que ce soit ou de recommandation d'en acheter ou d'en vendre. La distribution et l'offre d'actions ou de parts de l'OPC cité peuvent être limitées ou interdites par la loi dans certaines juridictions. Ce document ne donne aucune assurance de l'adéquation de l'OPC à la situation financière, au profil de risque, à l'expérience ou aux objectifs de l'investisseur. Avant d'investir dans ce fonds, l'investisseur doit procéder à sa propre analyse en s'appuyant sur les conseils de son choix. Abellie Asset Management décline toute responsabilité quant à d'éventuels dommages ou pertes résultant de l'utilisation en tout ou partie des éléments figurant dans ce document. Le prospectus, le DICI, ainsi que les derniers états financiers disponibles, sont à la disposition du public sur simple demande, auprès d'Abellie Asset Management. Ce document ne peut être reproduit sous quelque forme que ce soit ou transmis à une autre personne que celle à qui il est adressé. Le 22 novembre 2021, Aviva Investors France change de nom et devient Abellie Asset Management. Ce changement de dénomination sociale s'inscrit dans le cadre de l'intégration des entités du Groupe Aviva à Aéma Groupe à la suite de la cession des activités françaises du Groupe Aviva plc à Aéma Groupe en date du 30 septembre 2021. Abellie Asset Management n'appartient plus au groupe Aviva plc, elle ne saurait être tenue responsable des publications effectuées par Aviva plc et ses filiales sur le territoire français.