

# SG MONETAIRE PLUS - I

REPORTING

Communication  
Publicitaire

30/09/2024

MONÉTAIRE STANDARD ■

Article 8 ■ Label ISR

## Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : 25 007,5149 ( EUR )

Date de VL et d'actif géré : 30/09/2024

Actif géré : 13 804,38 ( millions EUR )

Code ISIN : FR0000003964

Code Bloomberg : SOGMONP FP

Code Reuters : LP60037935

Code SEDOL : -

Indice de référence : 100% €STR CAPITALISE (OIS)

Type de VL Monétaire : VL variable

## Objectif d'investissement

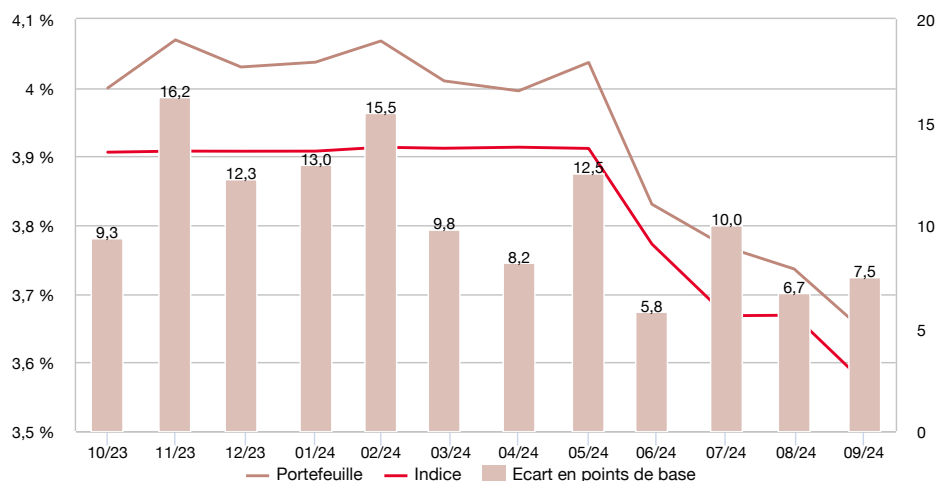
Sicav investie principalement en titres des marchés monétaire et obligataire, émis sur le marché de la zone euro. Son objectif est de surperformer l'ESTR, sur la durée de placement recommandée, après prise en compte des frais courants.

## Label ISR



## Fonds non garanti en capital

## Performances (Source : Fund Admin) - Les performances passées ne préjugent pas des performances futures



## Indicateur de risque (Source : Fund Admin)



Risque le plus faible

Risque le plus élevé

L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous gardez le produit pendant 1 Jour à 3 Mois. L'indicateur synthétique de risque permet d'apprécier le niveau de risque de ce produit par rapport à d'autres. Il indique la probabilité que ce produit enregistre des pertes en cas de mouvements sur les marchés ou d'une impossibilité de notre part de vous payer.

## WAM et WAL (en jours, source : Amundi)

	WAL	WAM
30/09/2024	131	5
30/08/2024	118	3
31/07/2024	128	4
28/06/2024	128	5
31/05/2024	141	4
30/04/2024	135	5
29/03/2024	131	6
29/02/2024	121	5
31/01/2024	111	6
29/12/2023	120	6
30/11/2023	135	5
31/10/2023	120	1

WAL (Weighted Average Life) : Durée de vie moyenne pondérée (DVMP) exprimée en nombre de jours  
WAM (Weighted Average Maturity) : Maturité moyenne pondérée (MMP) exprimée en nombre de jours

## Indicateur(s) glissant(s) (Source : Fund Admin)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Volatilité du portefeuille	0,04%	0,27%	0,27%	0,21%
Volatilité de l'indice	0,04%	0,27%	0,27%	0,21%
Tracking Error ex-post	0,01%	0,01%	0,01%	0,02%

\* La volatilité est un indicateur statistique qui mesure l'amplitude des variations d'un actif autour de sa moyenne. Exemple : des variations de +/- 1,5% par jour sur les marchés correspondent à une volatilité de 25% par an.

## Performances glissantes \* (Source : Fund Admin)

Depuis le	Depuis le	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Depuis le
	29/12/2023	30/08/2024	28/06/2024	29/09/2023	30/09/2021	30/09/2019	30/09/2014	11/04/1996
Portefeuille	3,96%	3,65%	3,73%	4,06%	2,07%	1,06%	0,48%	1,75%
Indice	3,85%	3,57%	3,65%	3,95%	2,02%	1,01%	0,36%	1,68%
Ecart	0,10%	0,07%	0,08%	0,11%	0,06%	0,04%	0,12%	0,08%

## Performances calendaires \* (Source : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Portefeuille	3,39%	-0,01%	-0,56%	-0,40%	-0,31%	-0,29%	-0,17%	-0,03%	0,16%	0,39%
Indice	3,29%	-0,02%	-0,49%	-0,47%	-0,40%	-0,37%	-0,36%	-0,32%	-0,11%	0,10%
Ecart	0,10%	0,01%	-0,07%	0,07%	0,09%	0,08%	0,19%	0,30%	0,27%	0,29%

\* Source : Fund Admin. Les performances sont calculées dans la devise de référence, sur des données historiques. Les performances affichées sont nettes de frais de gestion. (1) Les performances calendaires couvrent des périodes complètes de 12 mois pour chaque année civile. Les performances sont annualisées sur une base de 360 jours sur une période < 1 an et 365 jours sur une période > 1 an (exprimées à l'arrondi supérieur). La valeur des investissements peut varier à la hausse ou à la baisse selon l'évolution des marchés.

La décision de l'investisseur d'investir dans le fonds visé doit tenir compte de toutes les caractéristiques ou de tous les objectifs du fonds. Rien ne garantit que les considérations ESG amélioreront la stratégie d'investissement ou la performance d'un fonds.

## MONÉTAIRE STANDARD ■



**Elise Houe**

Responsable gestion monétaire

### Commentaire de gestion

#### Politique monétaire :

La Banque Centrale Européenne a baissé ses taux d'intervention le 12 septembre (effectif le 18 septembre) amenant le taux refi à 3.65%, le taux de facilité de dépôt et le taux marginal s'établissant respectivement à 3.50% et 3.90%.

Comme annoncé le 13 mars, l'écart entre le taux d'intérêt des opérations principales de refinancement et le taux des dépôts est ramené de 50 à 15 bp.

Le niveau de l'€str s'est établi aux alentours de 3.41% contre 3.66% au cours du mois.

Lors de sa réunion, la BCE a confirmé que la décision sur l'ampleur de la réduction du taux de dépôt a été unanime. La principale préoccupation reste l'inflation intérieure et l'évolution des salaires.

La BCE continuera à suivre une approche dépendante des données, elle souhaite conserver toutes les options disponibles. Ainsi, le marché aura une attention particulière sur la prochaine réunion du conseil des gouverneurs qui aura lieu le 17 octobre.

#### Politique de gestion :

- Liquidité :

La liquidité instantanée a été essentiellement assurée par des opérations de dépôt à terme au jour le jour.

- Risque de taux :

La maturité moyenne pondérée (MMP) du portefeuille s'établit à 5 jours en fin de période.

- Risque de crédit :

Les spreads court terme sont restés stables en fin de période, ils ressortent sur les maturités de 3 mois à 1 an à des niveaux respectifs d'€str + 10 à €str + 28 bps.

La pondération en titres obligataires ressort en fin de mois à environ 13% de l'actif du fonds. La part des émetteurs notés BBB représente en fin de mois environ 12% du portefeuille.

- Durée de vie moyenne et rating moyen :

La durée de vie moyenne pondérée (DVMP) de ce portefeuille appartenant à la catégorie monétaire est de 131 jours.

Le rating long terme moyen du portefeuille se maintient à un bon niveau de A.

- Dimension socialement responsable :

Le portefeuille présente une note moyenne ISR de C en fin de mois, soit un niveau supérieur à celui de son univers d'investissement retranché de 20% des émetteurs les moins bien notés D.

### Composition du portefeuille (Source : Amundi)

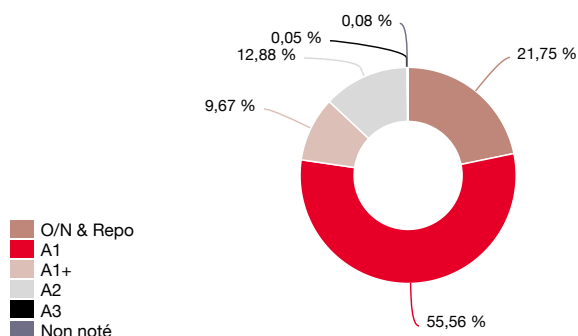
#### Principales lignes (Source : Amundi)

	Portefeuille	Maturité	Pays	Groupe d'instrument	Contrepartie *
ITALIAN REPUBLIC	2,51%	01/10/2024	Italie	Repo	UNICREDIT SPA
ITALIAN REPUBLIC	2,32%	01/10/2024	Italie	Repo	UNICREDIT SPA
ITALIAN REPUBLIC	2,04%	01/10/2024	Italie	Repo	UNICREDIT SPA
ITALIAN REPUBLIC	1,48%	01/10/2024	Italie	Repo	UNICREDIT SPA
ITALIAN REPUBLIC	1,08%	01/10/2024	Italie	Repo	UNICREDIT SPA
NATIXIS SA	0,74%	06/05/2025	France	Monétaire	-
COOPERATIEVE RABOBANK UA	0,74%	22/11/2024	Pays-Bas	Monétaire	-
ELECTRICITE DE FRANCE SA	0,74%	12/12/2024	France	Monétaire	-
BANCO SANTANDER SA	0,71%	10/09/2025	Espagne	Monétaire	-
DNB BANK ASA	0,71%	11/10/2024	Norvège	Monétaire	-

\* Pour les prises en pension, la maturité affichée correspond au temps nécessaire pour déboucler l'opération

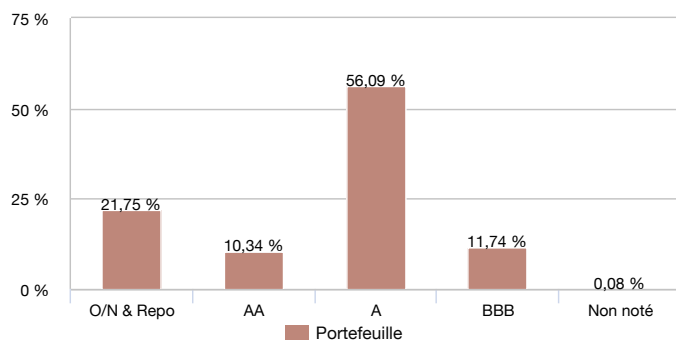
\* Colonne contrepartie: information uniquement disponible pour les prises en pension

#### Répartition par notations court terme (Source : Amundi) \*



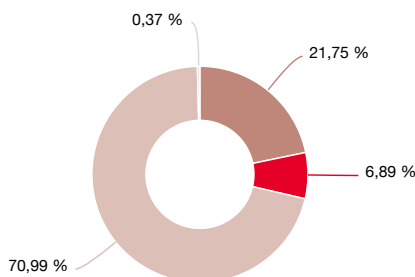
\* Rating médian calculé des trois agences de notation de crédit: Fitch, Moody's et Standard & Poor's

#### Répartition par notations long terme (Source : Amundi) \*

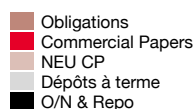
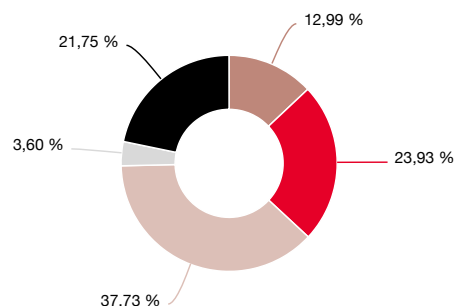


\* Rating médian calculé des trois agences de notation de crédit: Fitch, Moody's et Standard & Poor's

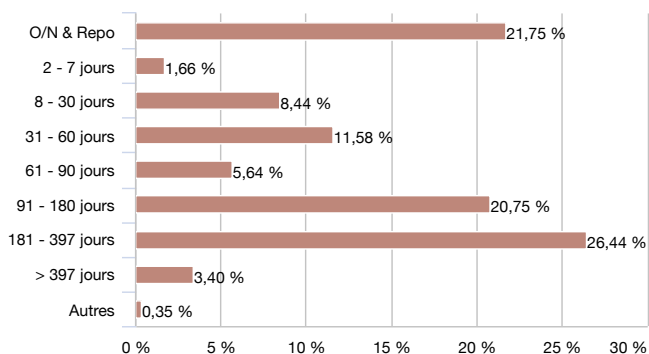
## Répartition du portefeuille - Secteurs (Source : Amundi)



## Répartition du portefeuille - Types d'instruments (Source : Amundi)

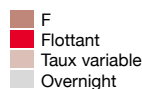
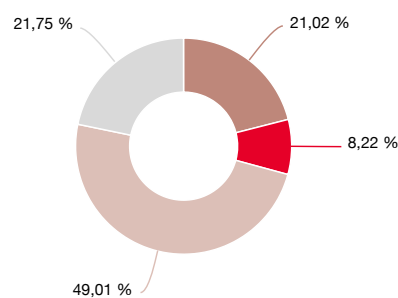


## Répartition par maturités (Source : Amundi) \*



\* O/N & Repo : liquidités placées au jour le jour

## Répartition par type de taux (Source : Amundi)



## Indicateurs (Source : Amundi)

	Portefeuille
<b>Sensibilité *</b>	0,01
<b>Note moyenne</b>	A
<b>Nombre de lignes</b>	340
<b>Nombre d'émetteurs</b>	83

\* La sensibilité (en points) représente le changement en pourcentage du prix pour une évolution de 1% du taux de référence

## MONÉTAIRE STANDARD ■

**Ratio de Liquidités \* (Source : Amundi)**

Actifs à échéance journalière	18.84 %
Actifs à échéance hebdomadaire	28.69 %

**\*RÈGLEMENT (UE) 2017/1131 sur les Fonds Monétaires**

Pour les fonds monétaires standard, au moins 7,5 % de ses actifs sont à échéance journalière ou sont constitués d'accords de prise en pension auxquels il peut être mis fin moyennant un préavis d'un jour ouvrable ou de liquidités dont le retrait peut être effectué moyennant un préavis d'un jour ouvrable; au moins 15 % de ses actifs sont à échéance hebdomadaire ou sont constitués d'accords de prise en pension auxquels il peut être mis fin moyennant un préavis de cinq jours ouvrables ou de liquidités dont le retrait peut être effectué moyennant un préavis de cinq jours ouvrables.

**Matrice Notations long terme / Maturités (Source : Amundi)**

	AA	AA-	A+	A	A-	BBB+	BBB	BBB-	Non noté	O/N & Repo	Total
0-4 mois	1,74%	4,20%	15,26%	4,30%	0,74%	1,56%	4,80%	0,05%	0,05%	21,75%	54,44%
4-12 mois	1,90%	2,28%	23,79%	7,85%	0,48%	0,04%	4,94%	-	-	-	41,29%
12-18 mois	-	0,18%	0,42%	1,65%	0,56%	-	-	-	-	-	2,81%
18-24 mois	-	0,03%	0,30%	0,28%	0,46%	-	-	-	0,03%	-	1,11%
Autres	-	-	-	-	-	-	0,35%	-	-	-	0,35%
<b>Total</b>	<b>3,65%</b>	<b>6,69%</b>	<b>39,78%</b>	<b>14,08%</b>	<b>2,23%</b>	<b>1,60%</b>	<b>10,09%</b>	<b>0,05%</b>	<b>0,08%</b>	<b>21,75%</b>	<b>100%</b>

**Matrice Pays / Secteurs / Maturités (Source : Amundi)**

	0-1 mois	1-3 mois	3-6 mois	6-12 mois	1-2 ans	N/A	Total
<b>Zone Euro</b>	<b>6,27%</b>	<b>14,21%</b>	<b>18,01%</b>	<b>22,65%</b>	<b>1,55%</b>	-	<b>62,68%</b>
<b>Belgique</b>	-	<b>0,55%</b>	<b>0,26%</b>	<b>0,32%</b>	<b>0,25%</b>	-	<b>1,38%</b>
Finance	-	0,55%	0,26%	0,32%	0,25%	-	1,38%
<b>Finlande</b>	<b>1,35%</b>	<b>0,10%</b>	<b>0,28%</b>	<b>1,16%</b>	-	-	<b>2,89%</b>
Finance	1,35%	0,10%	0,28%	1,16%	-	-	2,89%
<b>France</b>	<b>2,98%</b>	<b>8,41%</b>	<b>13,20%</b>	<b>16,23%</b>	<b>1,29%</b>	-	<b>42,12%</b>
Corporate	0,48%	1,98%	0,46%	-	0,19%	-	3,11%
Finance	2,14%	6,44%	12,74%	16,23%	1,11%	-	38,64%
Etats & Agences	0,37%	-	-	-	-	-	0,37%
<b>Allemagne</b>	<b>0,05%</b>	<b>0,21%</b>	-	-	-	-	<b>0,26%</b>
Corporate	0,05%	0,21%	-	-	-	-	0,26%
<b>Irlande</b>	-	<b>0,15%</b>	-	-	-	-	<b>0,15%</b>
Finance	-	0,15%	-	-	-	-	0,15%
<b>Italie</b>	<b>0,16%</b>	<b>1,47%</b>	<b>1,82%</b>	<b>1,45%</b>	-	-	<b>4,89%</b>
Corporate	-	0,22%	-	-	-	-	0,22%
Finance	0,16%	1,24%	1,82%	1,45%	-	-	4,67%
<b>Luxembourg</b>	<b>0,29%</b>	<b>1,16%</b>	<b>0,85%</b>	<b>1,04%</b>	-	-	<b>3,33%</b>
Finance	0,29%	1,16%	0,85%	1,04%	-	-	3,33%
<b>Pays-Bas</b>	<b>0,72%</b>	<b>2,04%</b>	<b>1,35%</b>	<b>1,30%</b>	-	-	<b>5,41%</b>
Corporate	-	-	0,04%	-	-	-	0,04%
Finance	0,72%	2,04%	1,31%	1,30%	-	-	5,37%
<b>Espagne</b>	<b>0,71%</b>	<b>0,12%</b>	<b>0,26%</b>	<b>1,15%</b>	-	-	<b>2,24%</b>
Finance	0,71%	0,12%	0,26%	1,15%	-	-	2,24%
<b>Reste du monde</b>	<b>3,83%</b>	<b>3,00%</b>	<b>2,74%</b>	<b>3,27%</b>	<b>2,37%</b>	<b>0,35%</b>	<b>15,57%</b>
<b>Canada</b>	-	<b>0,31%</b>	<b>0,20%</b>	<b>1,31%</b>	<b>1,03%</b>	-	<b>2,85%</b>
Finance	-	0,31%	0,20%	1,31%	1,03%	-	2,85%
<b>Danemark</b>	<b>0,28%</b>	-	-	-	-	-	<b>0,28%</b>
Finance	0,28%	-	-	-	-	-	0,28%
<b>Japon</b>	<b>0,59%</b>	<b>0,77%</b>	-	-	<b>0,86%</b>	-	<b>2,22%</b>
Corporate	-	0,47%	-	-	0,86%	-	1,33%
Finance	0,59%	0,30%	-	-	-	-	0,89%
<b>Jersey</b>	<b>0,17%</b>	-	-	-	-	-	<b>0,17%</b>
Corporate	0,17%	-	-	-	-	-	0,17%
<b>Norvège</b>	<b>0,71%</b>	-	-	-	-	-	<b>0,71%</b>
Finance	0,71%	-	-	-	-	-	0,71%
<b>Suède</b>	<b>1,43%</b>	<b>0,71%</b>	<b>1,27%</b>	<b>1,96%</b>	<b>0,48%</b>	-	<b>5,85%</b>
Corporate	-	-	-	-	0,48%	-	0,48%
Finance	1,43%	0,71%	1,27%	1,96%	-	-	5,37%
<b>Royaume-Uni</b>	<b>0,15%</b>	<b>0,65%</b>	<b>1,07%</b>	-	-	-	<b>1,87%</b>
Corporate	0,08%	0,08%	-	-	-	-	0,16%
Finance	0,07%	0,57%	1,07%	-	-	-	1,71%
<b>États-Unis</b>	<b>0,49%</b>	<b>0,56%</b>	<b>0,21%</b>	-	-	<b>0,35%</b>	<b>1,62%</b>
Corporate	-	0,56%	0,21%	-	-	0,35%	1,12%
Finance	0,49%	-	-	-	-	-	0,49%
<b>O/N &amp; repo</b>	-	<b>21,75%</b>	-	-	-	-	<b>21,75%</b>

## Caractéristiques principales (Source : Amundi)

Forme juridique	SICAV
Droit applicable	de droit français
Société de gestion	Société Générale Gestion
Dépositaire	SGSS - Paris
Date de création de la classe	03/04/1996
Devise de référence de la classe	EUR
Classification AMF	Monétaire standard
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation
Code ISIN	FR0000003964
Code Bloomberg	SOGMONP FP
Souscription minimum: 1ère / suivantes	1 000 000 Euros / 1 millième part(s)/action(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Limite de réception des ordres	-
Frais d'entrée (maximum)	1,00%
Frais Gestion Financière Direct	0,16% TTC
Commission de surperformance	Oui
Commission de surperformance (% par an)	30,00%
Frais de sortie (maximum)	0,00%
Frais de gestion et autres coûts administratifs ou d'exploitation	0,12%
Coûts de transaction	0,05%
Frais de conversion	
Durée minimum d'investissement recommandée	1 Jour à 3 Mois
Historique de l'indice de référence	15/12/2021: 100.00% €STR CAPITALISE (OIS) 01/09/2010: 100.00% EONIA CAPITALISE (O.I.S.) (BASE 360) - DISCONTINUED 11/04/1996: 100.00% EONIA CAPITALISE
Norme européenne	OPCVM
Cours connu/inconnu	Cours inconnu
Date de valeur rachat	J
Date de valeur souscription	J
Particularité	Non

**Votre fonds présente un risque de perte en capital supporté par l'investisseur. Sa valeur liquidative peut fluctuer et le capital investi n'est pas garanti. Le fonds ne peut en aucun cas s'appuyer sur un soutien extérieur pour garantir ou stabiliser sa valeur liquidative. Investir dans un fonds monétaire est différent d'un investissement dans des dépôts bancaires.**

## Avertissement

Ce document est fourni à titre d'information seulement et il ne constitue en aucun cas une recommandation, une sollicitation ou une offre, un conseil ou une invitation d'achat ou de vente des parts ou actions des FCP, FCPE, SICAV, compartiment de SICAV, SPPICAV présentés dans ce document (« les OPC ») et ne doit en aucun cas être interprété comme tel. Ce document ne constitue pas la base d'un contrat ou d'un engagement de quelque nature que ce soit. Toutes les informations contenues dans ce document peuvent être modifiées sans préavis. La société de gestion n'accepte aucune responsabilité, directe ou indirecte, qui pourrait résulter de l'utilisation de toutes informations contenues dans ce document. La société de gestion ne peut en aucun cas être tenue responsable pour toute décision prise sur la base de ces informations. Les informations contenues dans ce document vous sont communiquées sur une base confidentielle et ne doivent être ni copiées, ni reproduites, ni modifiées, ni traduites, ni distribuées sans l'accord écrit préalable de la société de gestion, à aucune personne tierce ou dans aucun pays où cette distribution ou cette utilisation serait contraire aux dispositions légales et réglementaires ou imposerait à la société de gestion ou à ses fonds de se conformer aux obligations d'enregistrement auprès des autorités de tutelle de ces pays. Tous les OPC ne sont pas systématiquement enregistrés dans le pays de juridiction de tous les investisseurs. Investir implique des risques : les performances passées des OPC présentées dans ce document ainsi que les simulations réalisées sur la base de ces dernières, ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. Elles ne préjugent pas des performances futures de ces derniers. Les valeurs des parts ou actions des OPC sont soumises aux fluctuations du marché, les investissements réalisés peuvent donc varier tant à la baisse qu'à la hausse. Par conséquent, les souscripteurs des OPC peuvent perdre tout ou partie de leur capital initialement investi. Il appartient à toute personne intéressée par les OPC, préalablement à toute souscription, de s'assurer de la compatibilité de cette souscription avec les lois dont elle relève ainsi que des conséquences fiscales d'un tel investissement et de prendre connaissance des documents réglementaires en vigueur de chaque OPC. Les prospectus complets des OPC de droit français visés par l'Autorité des Marchés Financiers (AMF) sont disponibles gratuitement sur simple demande au siège social de la société de gestion. Concernant les mandats de gestion, ce document fait partie du relevé des activités de gestion de votre portefeuille et doit être lu conjointement avec tout autre relevé périodique ou avis de confirmation relatif aux opérations de votre portefeuille, fourni par votre teneur de compte. La source des données du présent document est la société de gestion sauf mention contraire. La date des données du présent document est celle indiquée en tête du document sauf mention contraire.

Ce document est destiné à être remis exclusivement aux investisseurs institutionnels, professionnels, qualifiés ou sophistiqués et aux distributeurs. Ne doit pas être remis au grand public, à la clientèle privée et aux particuliers au sens de toute juridiction, ni aux "US Persons". Les investisseurs visés sont, en ce qui concerne l'Union Européenne, les investisseurs "Professionnels" au sens de la Directive 2004/39/CE du 21 avril 2004 "MIF" ou, le cas échéant au sens de chaque réglementation locale et, dans la mesure où l'offre en Suisse est concernée, les "investisseurs qualifiés" au sens des dispositions de la Loi fédérale sur les placements collectifs (LPCC), de l'Ordonnance sur les placements collectifs du 22 Novembre 2006 (OPCC) et de la Circulaire FINMA 08/8 au sens de la législation sur les placements collectifs du 20 Novembre 2008. Ce document ne doit en aucun cas être remis dans l'Union Européenne à des investisseurs non "Professionnels" au sens de la MIF ou au sens de chaque réglementation locale, ou en Suisse à des investisseurs qui ne répondent pas à la définition d'"investisseurs qualifiés" au sens de la législation et de la réglementation applicable.

## Lexique ESG

### Investissement Socialement Responsable (ISR)

L'ISR traduit les objectifs du développement durable dans les décisions d'investissements en ajoutant les critères Environnementaux, Sociaux et de Gouvernance (ESG) en complément des critères financiers traditionnels.

L'ISR vise ainsi à concilier performance économique et impact social et environnemental en finançant les entreprises et les entités publiques qui contribuent au développement durable quel que soit leur secteur d'activité. En influençant la gouvernance et le comportement des acteurs, l'ISR favorise une économie responsable.

### Critères ESG

Il s'agit de critères extra-financiers utilisés pour évaluer les pratiques Environnementales, Sociales et la Gouvernance des entreprises, Etats ou collectivités :

- « E » pour Environnement (niveau de consommation d'énergie et de gaz, gestion de l'eau et des déchets...).
- « S » pour Social/Sociétal (respect des droits de l'homme, santé et sécurité au travail...).
- « G » pour Gouvernance (indépendance du conseil d'administration, respect des droits des actionnaires ...).

## ISR selon Amundi

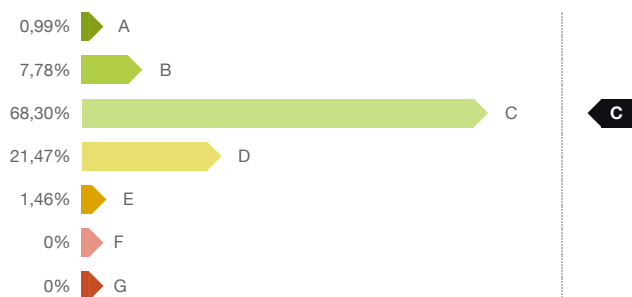
Un portefeuille ISR suit les règles suivantes :

- 1-Exclusion des notes F et G <sup>1</sup>
- 2-Notation globale du portefeuille supérieure à la notation de l'indice de référence / univers d'investissement après exclusion de 20% des émetteurs les moins bien notés
- 3-Notation ESG de 90% minimum du portefeuille <sup>2</sup>

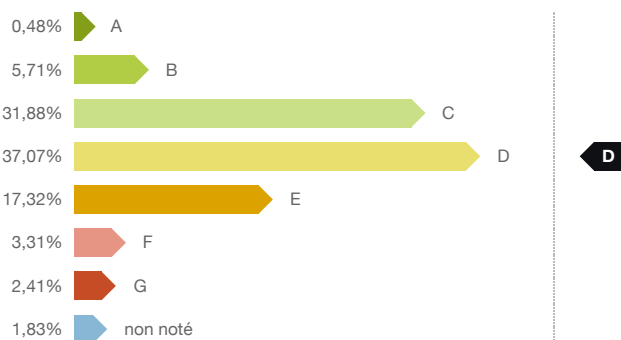
## NOTE ESG MOYENNE (source : Amundi)

Notation Environnementale, Sociale et de Gouvernance

### Du portefeuille<sup>2</sup>



### De l'univers de référence<sup>3</sup>



## Evaluation par critère ESG (Source : Amundi)

Environnement	C
Social	C
Gouvernance	C
<b>Note Globale</b>	<b>C</b>

## Couverture de l'analyse ESG<sup>2</sup> (Source : Amundi)

Nombre d'émetteurs	88
% du portefeuille noté ESG <sup>2</sup>	100%

## Label ISR



<sup>1</sup> En cas de déclassement des émetteurs notés en dessous de E, la société de gestion a vocation à vendre les titres dans les meilleurs délais et dans l'intérêt des actionnaires.

<sup>2</sup> Titres notables sur les critères ESG hors liquidités.

<sup>3</sup> L'univers d'investissement est défini par l'indicateur de référence du fonds. Si le fonds n'a pas d'indicateur, il se caractérise par la nature des titres, la zone géographique ainsi que les thèmes ou secteurs.



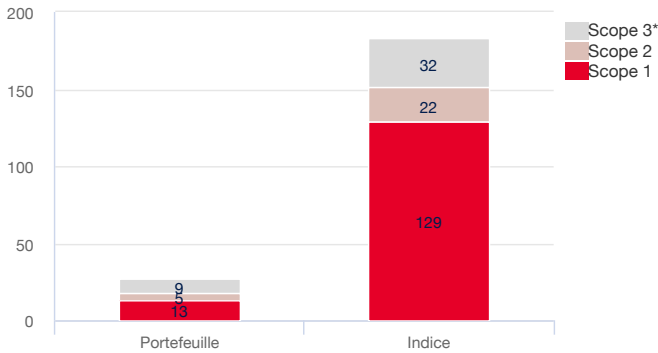
## Zoom sur des indicateurs Environnementaux, Sociaux et de Gouvernance

En complément de l'évaluation ESG globale du portefeuille et celle des dimensions E, S et G, le gérant utilise des indicateurs d'impact afin d'évaluer la qualité ESG du fonds sur les plans environnementaux, sociaux, de bonne gouvernance, et du respect des droits humains. A cette fin, quatre critères de performance ont été retenus et le fonds a pour objectif d'avoir un portefeuille affichant une meilleure performance que l'univers d'investissement de référence pour au moins deux de ces critères.

### Environnement<sup>1</sup>

#### Intensité carbone par million d'euros de chiffre d'affaires

Total en tCO<sub>2</sub> / M€ (portefeuille/indice) : 27 / 183



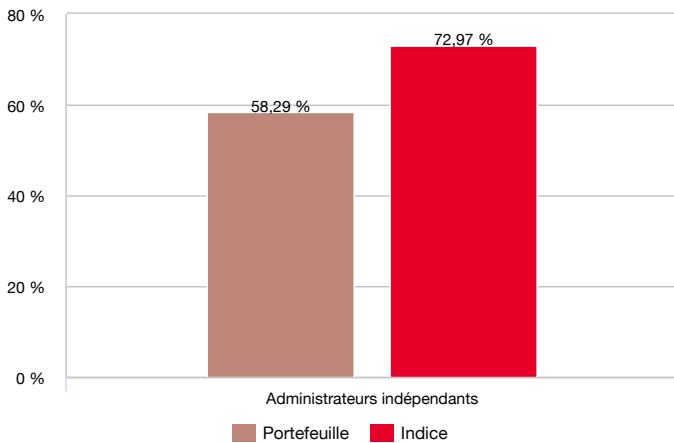
Cet indicateur mesure la moyenne des émissions en tonnes de CO<sub>2</sub> équivalent par unité de revenu des entreprises (en million d'euros de chiffre d'affaires).

\* Source: TRUCOST, fournisseurs de premier rang uniquement

Taux de couverture : 99,61% (Portefeuille) / 96,23% (Indice)

### Gouvernance<sup>4</sup>

#### Indépendance du Conseil d'Administration

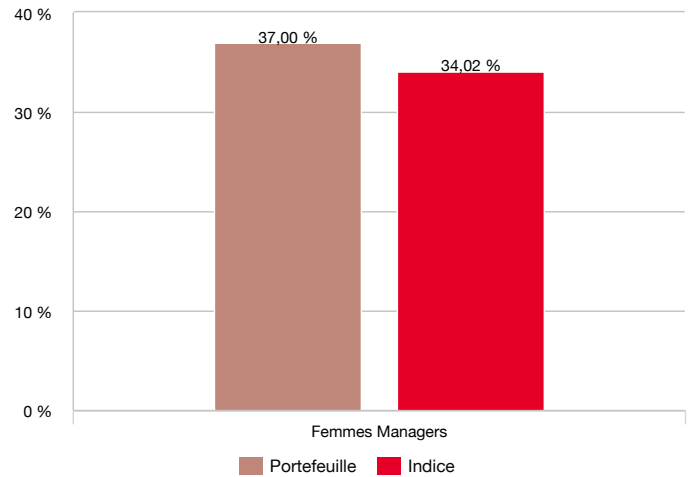


Pourcentage moyen d'administrateurs indépendants dans les conseils d'administration. Fournisseur de données : Refinitiv.

Taux de couverture (Portefeuille/Indice) : 75,50% / 92,56%

### Social<sup>2</sup>

#### Mixité des Managers

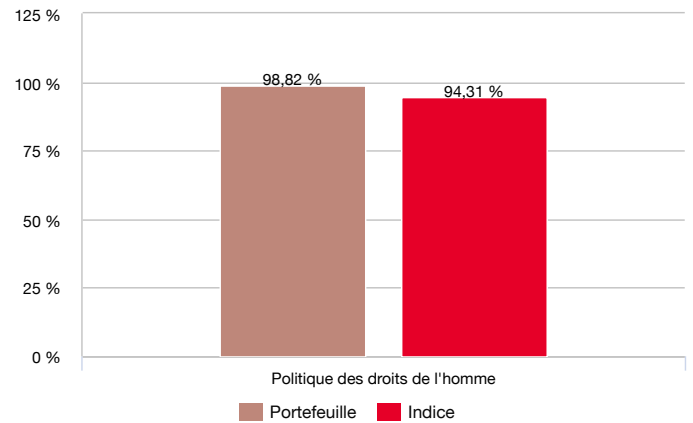


Pourcentage moyen de managers féminins au sein des entreprises.

Taux de couverture (Portefeuille/Indice) : 97,74% / 82,34%

### Respect des droits Humains<sup>3</sup>

#### Travail décent et liberté d'association



Pourcentage d'entreprises ayant une politique d'exclusion du travail des enfants, forcé ou obligatoire, ou garantissant la liberté d'association, appliquée universellement et indépendamment des lois locales. Fournisseur de données : Refinitiv.

Taux de couverture (portefeuille/indice) : 75,51% / 92,88%

## Sources et définitions

**1. Indicateur Environnement / indicateur climat.** Intensité en émissions carbone (en tCO<sub>2</sub> par million d'euros de chiffre d'affaire). Ces données sont fournies par Trucost. Elles correspondent aux émissions annuelles des entreprises et sont exprimées en tonnes équivalent CO<sub>2</sub>, i.e. elles regroupent les six gaz à effet de serre définis dans le protocole de Kyoto dont les émissions sont converties en potentiel de réchauffement global (PRG) en équivalent CO<sub>2</sub>.

Définition des scopes :

- Scope 1 : Ensemble des émissions directes provenant de sources détenues ou contrôlées par l'entreprise.

- Scope 2 : L'ensemble des émissions indirectes induites par l'achat ou la production d'électricité, de vapeur ou de chaleur.

- Scope 3 : Toutes les autres émissions indirectes, en amont et en aval de la chaîne de valeur. Pour des raisons de robustesse des données, Amundi a choisi d'utiliser les émissions provenant des activités en amont du scope 3 - Source : modèle EEI-O Trucost (modèle d'entrée/sortie étendu à l'environnement de Trucost).

**2. Indicateur Social:** Pourcentage de femmes managers. Pourcentage de femmes cadres parmi le total des cadres de l'entreprise. S'il existe une répartition en pourcentage par catégorie, comme les cadres supérieurs, les cadres supérieurs, les cadres moyens, les cadres subalternes, nous considérons alors le pourcentage de femmes cadres moyens. Pourcentage de femmes cadres = nombre de femmes cadres/nombre total de cadres\*100. Fournisseur de données : Refinitiv.

**3. Indicateur Respect des Droits Humains.** Pourcentage d'entreprises ayant une politique d'exclusion du travail des enfants, forcé ou obligatoire, ou garantissant la liberté d'association, appliquée universellement et indépendamment des lois locales. Fournisseur de données : Refinitiv.

**4. Indépendance du Conseil d'Administration.** Pourcentage moyen d'administrateurs indépendants dans les Conseils d'Administration. Fournisseur de données : Refinitiv.

Pour ces 4 Indicateurs, le total du portefeuille/de l'univers d'investissement est égal à la moyenne des indicateurs des entreprises pondérée par le poids des entreprises dans le portefeuille/l'univers d'investissement.

Ce document est destiné à être remis exclusivement aux investisseurs institutionnels, professionnels, qualifiés ou sophistiqués et aux distributeurs. Ne doit pas être remis au grand public, à la clientèle privée et aux particuliers au sens de toute juridiction, ni aux "US Persons". Les investisseurs visés sont, en ce qui concerne l'Union Européenne, les investisseurs "Professionnels" au sens de la Directive 2004/39/CE du 21 avril 2004 "MIF" ou, le cas échéant au sens de chaque réglementation locale et, dans la mesure où l'offre en Suisse est concernée, les "investisseurs qualifiés" au sens des dispositions de la Loi fédérale sur les placements collectifs (LPCC), de l'Ordonnance sur les placements collectifs du 22 Novembre 2006 (OPCC) et de la Circulaire FINMA 08/8 au sens de la législation sur les placements collectifs du 20 Novembre 2008. Ce document ne doit en aucun cas être remis dans l'Union Européenne à des investisseurs non "Professionnels" au sens de la MIF ou au sens de chaque réglementation locale, ou en Suisse à des investisseurs qui ne répondent pas à la définition d'"investisseurs qualifiés" au sens de la législation et de la réglementation applicable.

## Avertissement

Ce document est fourni à titre d'information seulement et il ne constitue en aucun cas une recommandation, une sollicitation ou une offre, un conseil ou une invitation d'achat ou de vente des parts ou actions des FCP, FCPE, SICAV, compartiment de SICAV, SPICAV présentés dans ce document (« les OPC ») et ne doit en aucun cas être interprété comme tel. Ce document ne constitue pas la base d'un contrat ou d'un engagement de quelque nature que ce soit. Toutes les informations contenues dans ce document peuvent être modifiées sans préavis. La société de gestion n'accepte aucune responsabilité, directe ou indirecte, qui pourrait résulter de l'utilisation de toutes informations contenues dans ce document. La société de gestion ne peut en aucun cas être tenue responsable pour toute décision prise sur la base de ces informations. Les informations contenues dans ce document vous sont communiquées sur une base confidentielle et ne doivent être ni copiées, ni reproduites, ni modifiées, ni traduites, ni distribuées sans l'accord écrit préalable de la société de gestion, à aucune personne tierce ou dans aucun pays où cette distribution ou cette utilisation serait contraire aux dispositions légales et réglementaires ou imposerait à la société de gestion ou à ses fonds de se conformer aux obligations d'enregistrement auprès des autorités de tutelle de ces pays. Tous les OPC ne sont pas systématiquement enregistrés dans le pays de juridiction de tous les investisseurs. Investir implique des risques : les performances passées des OPC présentées dans ce document ainsi que les simulations réalisées sur la base de ces dernières, ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. Elles ne préjugent pas des performances futures de ces derniers. Les valeurs des parts ou actions des OPC sont soumises aux fluctuations du marché, les investissements réalisés peuvent donc varier tant à la baisse qu'à la hausse. Par conséquent, les souscripteurs des OPC peuvent perdre tout ou partie de leur capital initialement investi. Il appartient à toute personne intéressée par les OPC, préalablement à toute souscription, de s'assurer de la compatibilité de cette souscription avec les lois dont elle relève ainsi que des conséquences fiscales d'un tel investissement et de prendre connaissance des documents réglementaires en vigueur de chaque OPC. Les prospectus complets des OPC de droit français visés par l'Autorité des Marchés Financiers (AMF) sont disponibles gratuitement sur simple demande au siège social de la société de gestion. Concernant les mandats de gestion, ce document fait partie du relevé des activités de gestion de votre portefeuille et doit être lu conjointement avec tout autre relevé périodique ou avis de confirmation relatif aux opérations de votre portefeuille, fourni par votre teneur de compte. La source des données du présent document est la société de gestion sauf mention contraire. La date des données du présent document est celle indiquée en tête du document sauf mention contraire.