

Stratégie

Sur une période supérieure à un an, l'objectif est d'obtenir une performance supérieure à celle de son indicateur de référence, l'EONIA capitalisé, avec une volatilité 5 ans cible de 2%. Il offre une diversification aux fonds obligataires euros et aux fonds en euros, dans le cadre d'une gestion mixte encadrée sur le monétaire, les obligations, les obligations convertibles et les actions associées à des options. Il permet également de piloter la trésorerie à long terme avec une liquidité immédiate.

Données au 31/12/2018

Classification BdF : OPC mixte

Actif géré (parts A, B & D) : 444,01 M €

Indicateur de référence : EONIA Capitalisé

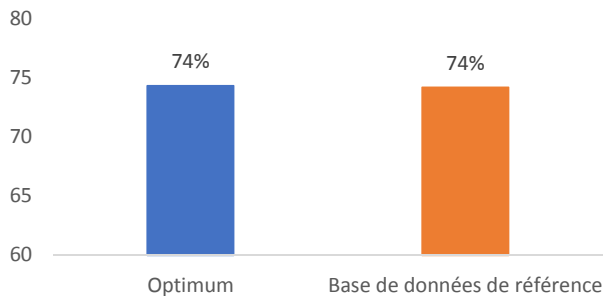
Éligibilité : Assurance-vie, compte titres

Environnement de comparaison* : émetteurs obligataires sur l'Europe, le Brésil, le Mexique, la Chine, le Japon et l'Australie, dont l'encours est d'au moins 300 millions, libellés en euros, présents sur des maturités (2/15 ans), HY ou IG

* Ne constitue pas un Benchmark au sens du Règlement (UE) 2016/1011 du Parlement Européen et du Conseil du 8 juin 2016

Satisfaction Client & Score ROC

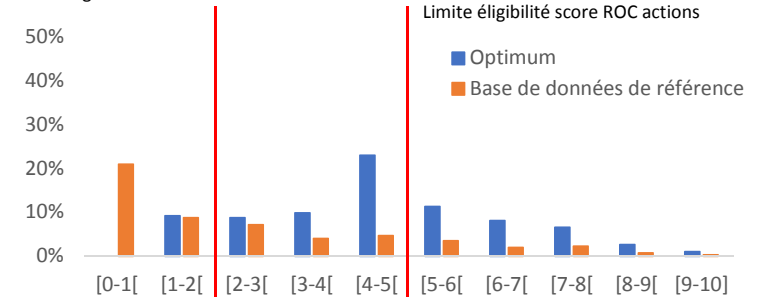
Satisfaction Client



Taux de Satisfaction Client moyen pondéré du poids des lignes en portefeuille.
Taux de couverture Optimum : 53% / Taux de couverture base de données de référence : 24%

Taux d'exclusion ISR : 47,98% (Univers d'étude : 5630 valeurs / Éligibles : 2701 valeurs / Portefeuille : 116 valeurs).
Source : Trusteam Finance (données externes retraitées)

Limite éligibilité score ROC taux

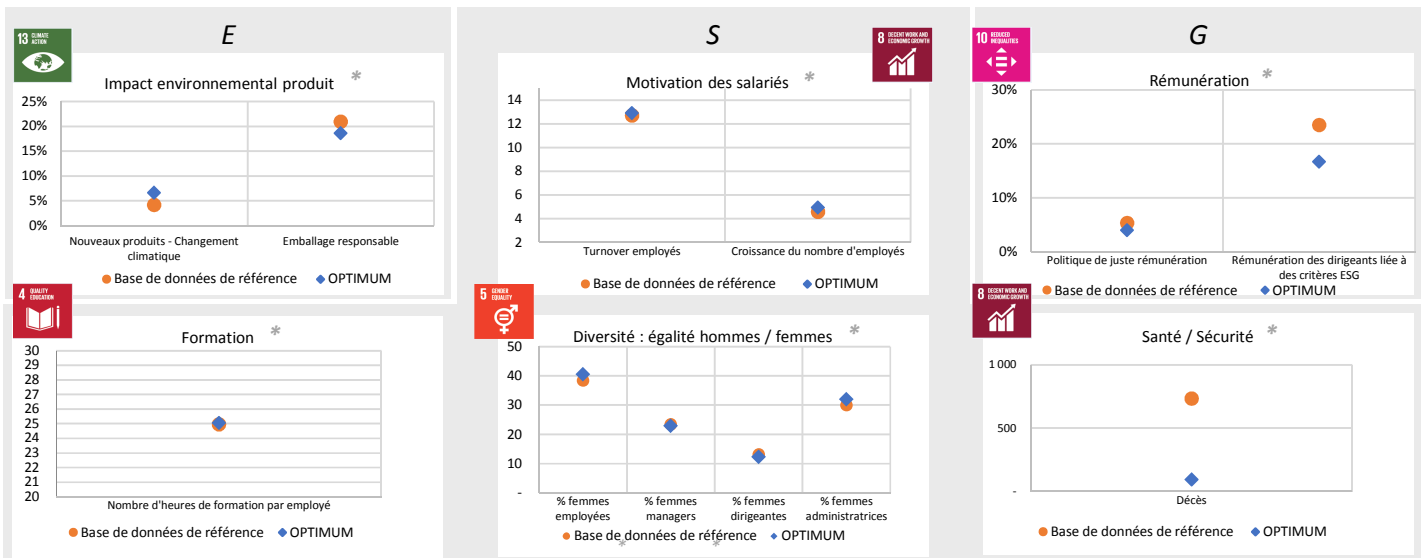


Score ROC

Répartition du portefeuille : somme du poids des lignes appartenant à l'intervalle de score ROC concerné. Taux d'éligibilité du ptf Optimum : 87%
Score ROC moyen pondéré du portefeuille Optimum : 4,48 / base de données de référence : 3,44

Impact ISR du portefeuille – Expérience Client

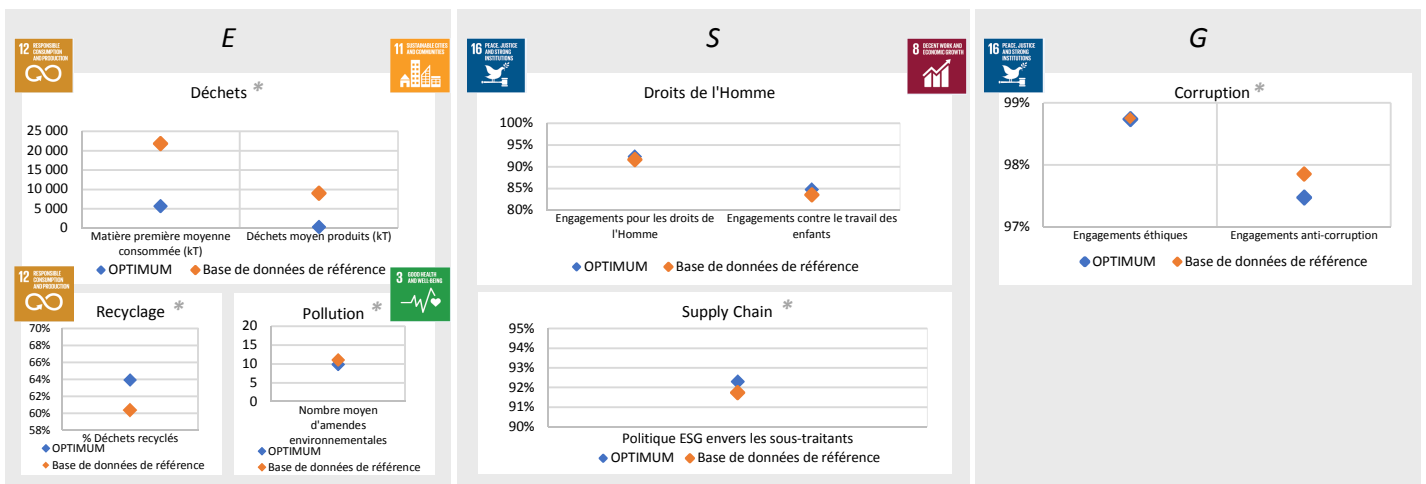
78% des 37 indicateurs d'impact ISR du portefeuille sont meilleurs que ceux de son benchmark (94% en E, 83% en S et 29% en G)



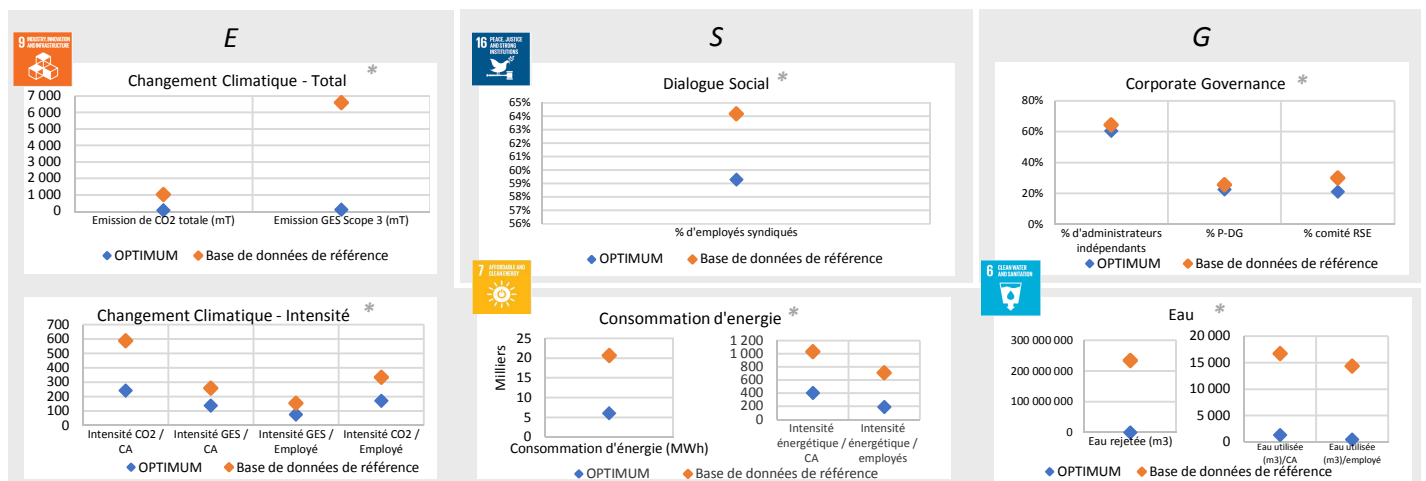
Le document présent vous est communiqué à titre purement indicatif et ne constitue ni une recommandation, ni une proposition ou une offre d'achat ou toute autre transaction portant sur les instruments financiers qui y sont visés, ni du conseil. Il convient de prendre connaissance de la version la plus récente du prospectus (disponible auprès de la société de gestion Trusteam Finance - 10, rue Lincoln, 75008 PARIS - 01 42 96 40 30 - et sur le site internet www.trusteam.fr) avant de souscrire. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures. Les performances ne sont pas constantes dans le temps.

Reporting extra financier au 31 Décembre 2018

Impact ISR du portefeuille – Réputation



Impact ISR du portefeuille – Développement Durable



L'ensemble des données est rebasé sur le taux de couverture (informations disponibles sur Bloomberg)
 * Données portant sur moins de 50% du portefeuille ou du benchmark - Sources : Bloomberg, Trusteam Finance

Engagement (S2 2018)

- Dialogue ouvert avec 54 sociétés sur la Satisfaction Client dans le cadre du process ROC
- Dans le cadre du Climate Action 100+, suivi de 7 sociétés, dont 2 en tant que porte parole de la coalition
- Résultats de nos analyses de stratégie client envoyées à 200 sociétés
- Rencontres avec 27 sociétés dans le cadre du Prix Excellence Client 2019. Ce prix a été créé en partenariat avec Ipsos & l'Académie du Service afin de récompenser les sociétés qui réussissent en prenant soin de leurs clients.

Dialogue ouvert : échange sur les critères d'éligibilité satisfaction client
 Remarque : toutes les données quantitatives de ce document portent sur les investissements actions et obligations corporate du fonds.

Controverses (Q4 2018)

- Environnement**
- ING : accusation par les ONG de financer des entreprises d'huile de palme
 - Renault, PSA : accusation de tricherie sur les émissions de diesel
 - Société Générale : critiqué pour contribuer aux émissions de gaz à effet de serre via ses activités de financement
- Social**
- Cemex: accusation d'infractions à la sécurité au travail
- Gouvernance**
- GE : investigation par la SEC des pratiques comptables et poursuite des actionnaires
 - ING : implication dans le scandale de blanchiment d'argent lié à Danske Bank
 - Intesa : implication dans une fraude sur les prix de vente des diamants
 - Renault : affaire Ghosn
 - Sacry : implication dans des pratiques anti-concurrentielles
 - Société Générale : paiement de 1,3md\$ pour régler les accusations de violation des sanctions américaines; poursuivi en justice par plusieurs investisseurs institutionnels pour manipulation du marché des changes aux Etats-Unis
 - Softbank : accusation d'évasion fiscale au Japon via des filiales dans des paradis fiscaux

Source : RepRisk : controverses sélectionnées par les gérants comme étant les plus importantes du trimestre.

Le document présent vous est communiqué à titre purement indicatif et ne constitue ni une recommandation, ni une proposition ou une offre d'achat ou toute autre transaction portant sur les instruments financiers qui y sont visés, ni du conseil. Il convient de prendre connaissance de la version la plus récente du prospectus (disponible auprès de la société de gestion Trusteam Finance - 10, rue Lincoln, 75008 PARIS - 01 42 96 40 30 - et sur le site internet www.trusteam.fr) avant de souscrire. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures. Les performances ne sont pas constantes dans le temps.