

Stratégie

Dans le cadre d'une gestion équilibrée, l'exposition aux marchés actions est comprise entre 0% et 50%, l'exposition aux marchés obligataire et monétaire entre 30% et 100%. Il investit également en actions sélectionnées selon l'approche « Satisfaction Client » mise en place par les équipes de gestion actions de Trusteam Finance, complétée éventuellement de stratégies d'options afin de limiter le risque. Le fonds investit sur des obligations et des instruments du marché monétaire. Il peut investir dans la limite de 15% en obligations convertibles libellées en €, en privilégiant les émetteurs répondant à notre process satisfaction client.

Données au 29/03/2019

Classification BdF : OPC mixte

Actif géré : 19,10M €

Indicateur de référence : 25% Eurostoxx 50, 50% Euro MTS 3-5 ans, 25% Eonia (indices TR)

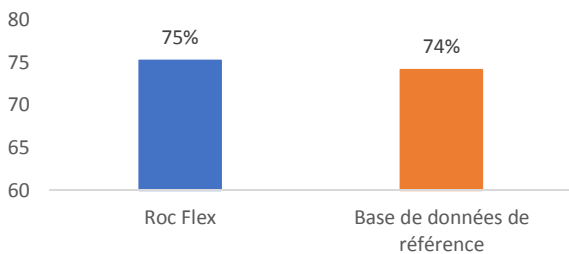
Éligibilité : Assurance-vie, compte titres

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

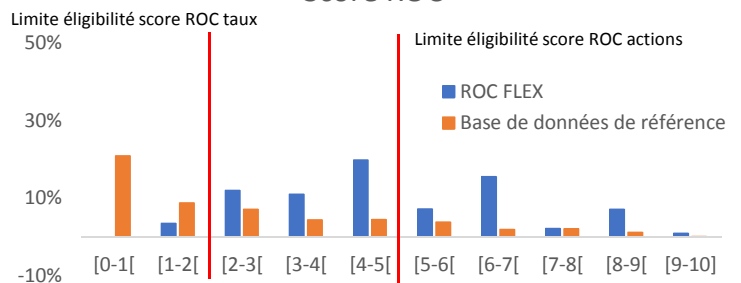
Satisfaction Client



Taux de Satisfaction Client moyen pondéré du poids des lignes en portefeuille.
Taux de couverture ROC Flex : 49% / Taux de couverture Base de données de référence : 24%

Taux d'exclusion ISR : 48,15 % (Univers d'étude : 5662 valeurs / Éligibles : 2726 valeurs / Portefeuille : 79 valeurs).
Source : Trusteam Finance (données externes retraitées)

Score ROC

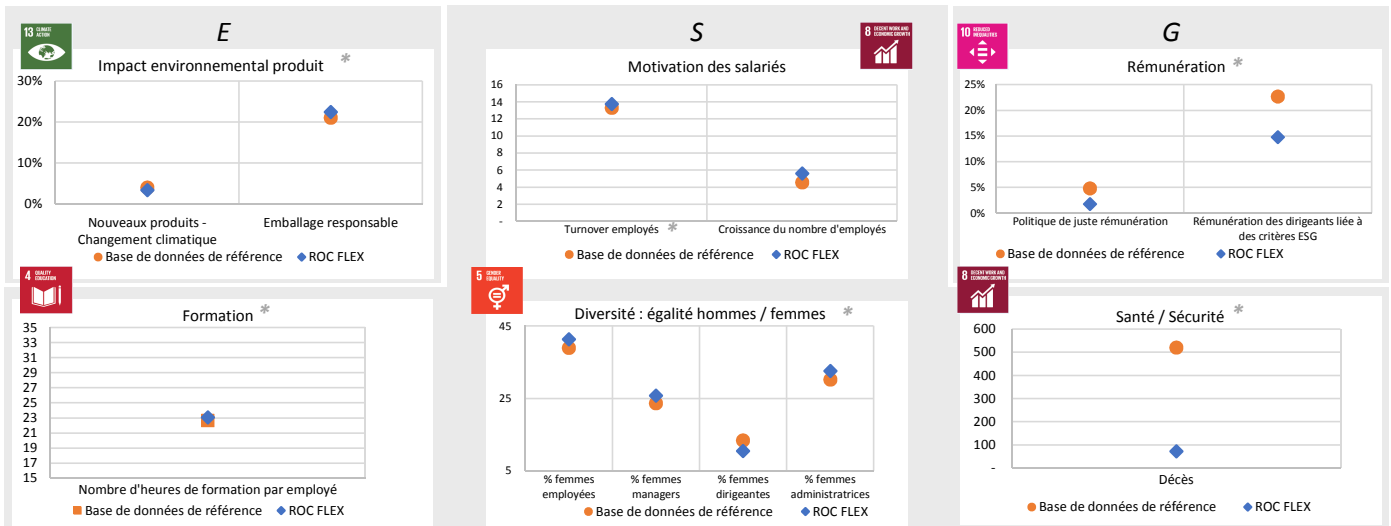


Répartition du portefeuille : somme du poids des lignes appartenant à l'intervalle de score ROC concerné. Taux d'éligibilité du ptf Roc Flex : 97,55%

Score ROC moyen pondéré du portefeuille Roc Flex : 4,88 / Base de données de référence : 3,44

Impact ISR du portefeuille – Expérience Client

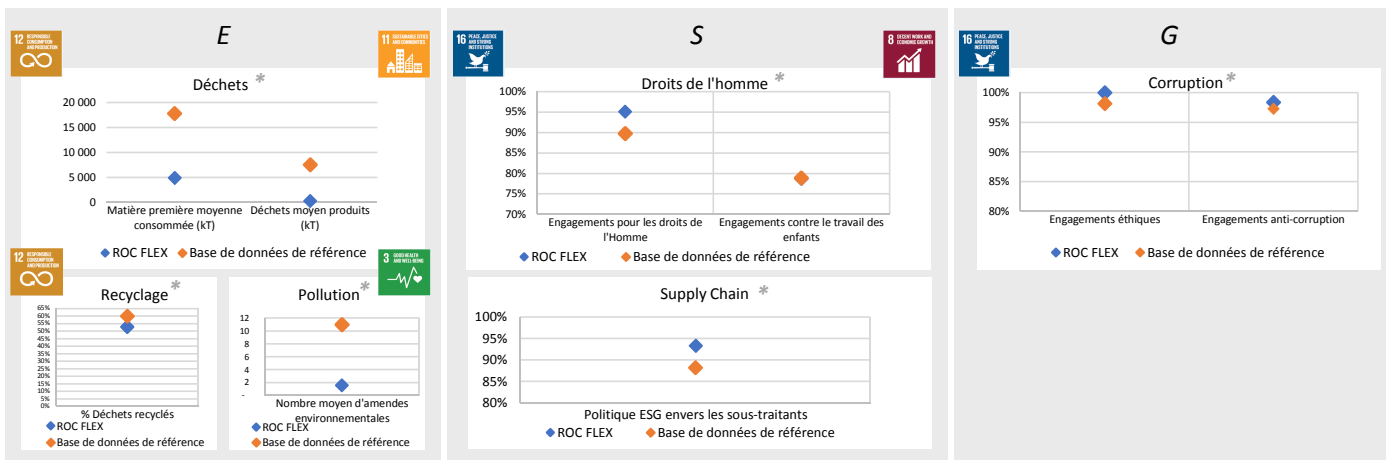
76% des 37 indicateurs d'impact ISR du portefeuille sont meilleurs que ceux de son benchmark (83% en E, 75% en S et 57% en G)



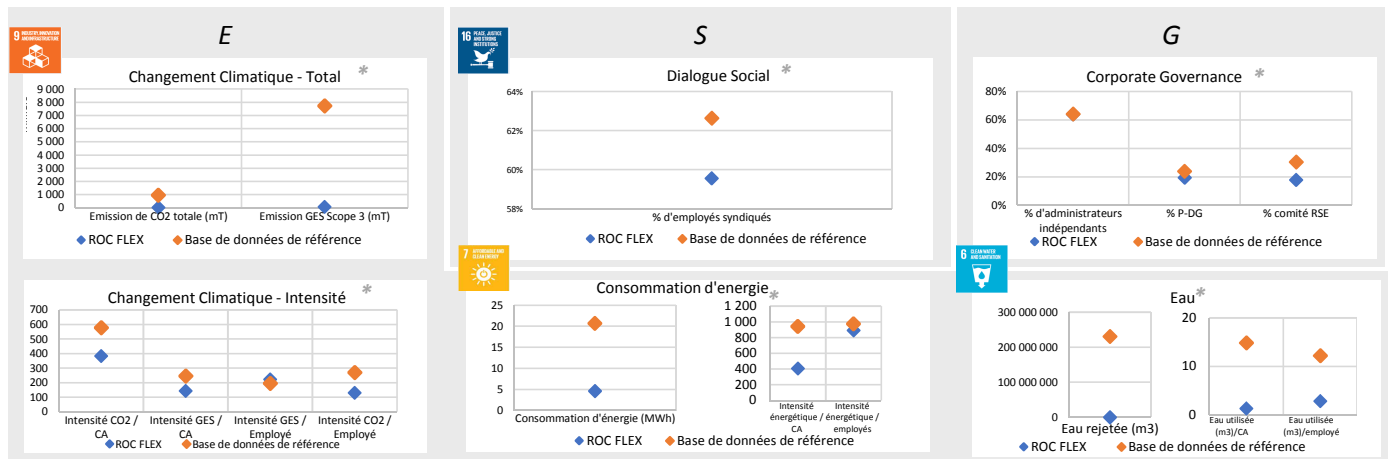
Le document présent vous est communiqué à titre purement indicatif et ne constitue ni une recommandation, ni une proposition ou une offre d'achat ou toute autre transaction portant sur les instruments financiers qui y sont visés, ni du conseil. Il convient de prendre connaissance de la version la plus 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 29 mars 2019

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 (T1 2019)

- Dialogue ouvert avec 40 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

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 (T1 2019)

- Environnement**
- Thomas Cook: poursuites par les syndicats pour exposer ses pilotes et son personnel naviguant à des fumées toxiques dans les avions
- Social**
- Mylan: rappel de plusieurs médicaments, entre autres, à cause d'impuretés cancérigènes
 - Geox: critiqué pour de mauvaises conditions dans sa chaîne d'approvisionnement en Italie
 - Faurecia: critiques sur les mauvaises conditions de travail dans ses usines de production aux Etats-Unis
- Gouvernance**
- Raiffeisen Bank: implication dans le scandale de blanchiment d'argent de Danske Bank portant sur plusieurs milliards de dollars
 - Mylan: enquêtes menées par les Autorités américaines sur une éventuelle entente sur les prix des génériques
 - GE: paiement d'une amende (GE Capital) de 49m\$ pour avoir dissimulé un système de Ponzi; les Boeing 737 Max qui se sont écrasés étaient équipés d'un nouveau moteur fabriqué conjointement par GE et Safran
 - Caixa Bank: accusation de participation dans un système mondial de blanchiment d'argent
 - Barclays: poursuites pour une fraude présumée liée à des emprunts bancaires d'une valeur de 550m€

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.