

Reporting Extra-Financier Trimestriel des titres vifs du portefeuille

Trusteam ROC Europe au 31 décembre 2024



Approche significativement engageante



Label ISR depuis 2017



Catégorisé Article 9 (SFDR)

Processus de sélectivité des titres vifs du portefeuille

Entreprises



L'univers d'investissement est constitué des entreprises cotées sur les principales places boursières des zones géographiques du fonds et analysé par notre process ROC « Satisfaction Client ».

L'univers investissable représente toutes les sociétés qui sont sélectionnées par notre process ROC « Satisfaction Client »

Plus d'information sur notre [code de transparence](#)

Le taux de couverture correspond au rapport entre le nombre de lignes sur lesquelles la donnée extra-financière est disponible et le nombre de lignes total

Indicateurs de surperformance des titres vifs du portefeuille

Taux de Satisfaction Client*



Trusteam ROC Europe : **78%**
Eurostoxx 50 : **77%**

Taux de couverture : ROC Europe : 100%, Eurostoxx 50 : 100%
Source : Trusteam Finance

*Une partie des scores de satisfaction client sont estimés en se basant sur la moyenne sectorielle de la valeur et en appliquant une décote de 30%. Le taux de satisfaction client, le score sont pondérés par le poids rebasé des lignes du portefeuille (Actif Net retraité des liquidités et des titres étatiques / parapubliques)

La performance extra-financière de Trusteam ROC Europe est comparé à celle de son indice de référence, l'Eurostoxx 50.

Emissions totales de CO2 (Scope 1-2-3)

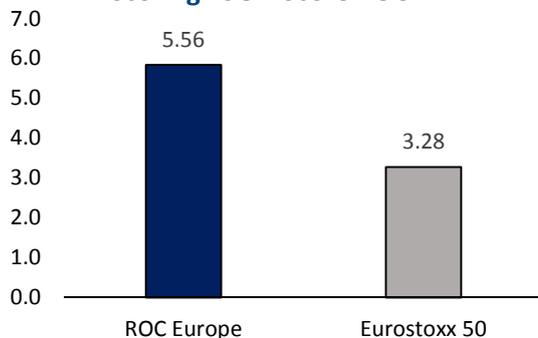


Trusteam ROC Europe : **460 773 130 tCO2**
Eurostoxx 50 : **3 600 810 820 tCO2**

Taux de couverture : ROC Europe : 91%, Eurostoxx 50 : 100%
Source : Carbon Disclosure Project (CDP)

Score ROC et Éligibilité des titres vifs du portefeuille

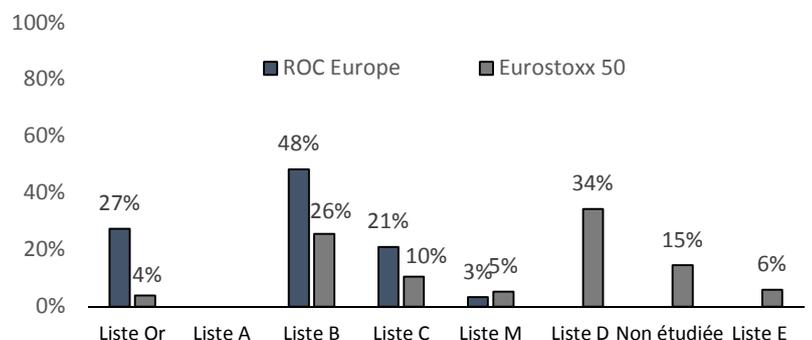
Scoring ESG = Score ROC



Taux d'analyse en fonction des pondérations :
ROC Europe : 100%, EuroStoxx 50 : 85%.

Plus de détails sur la mUne valeur est éligible lorsqu'elle appartient aux Listes A, B, C, M ou Or. Méthodologie du [Process ROC](#)

Éligibilité des titres vifs du portefeuille du fonds Trusteam ROC Europe vs l'EuroStoxx 50



100% des pondérations actions de Trusteam ROC Europe sont éligibles versus **45%** pour l'EuroStoxx 50.

Le process ROC (Return on Customer), basé sur le critère de la Satisfaction Client, est présenté de façon détaillée sur une page dédiée du site internet de Trusteam Finance et dans le Code de Transparence des fonds. Les limites méthodologiques du process ROC sont liées à la qualité et le degré de complétude des données obtenues sur les clients et sur les sociétés, variables selon les sociétés, les secteurs d'activité et les zones géographiques. Le lien entre le critère de la Satisfaction Client et la performance financière des entreprises repose sur des études académiques qui sont présentées de façon détaillée dans le Livre Blanc de Trusteam Finance, qui est disponible gratuitement sur demande. Les politiques ESG (dont la politique d'engagement actionnarial), les reportings extra-financiers des fonds Trusteam et autres reporting ESG (Rapport 29 LEC, Codes de Transparence, Rapports sur la mesure d'impact ISR, compte rendu sur la politique de vote et d'engagement) sont disponibles sur le site internet de Trusteam Finance. Plus d'informations sur : <https://www.trusteam.fr/nos-engagements/>

Reporting Extra-Financier Trimestriel des titres vifs du portefeuille

Trusteam ROC Europe au 31 décembre 2024

57% des indicateurs ESG du portefeuille sont meilleurs que ceux de l'EuroStoxx 50 (le fonds surperforme 59% des indicateurs environnementaux, 55% des indicateurs sociétaux et 57% des indicateurs de gouvernance)

Ensemble des indicateurs étudiés à retrouver dans le rapport de [performance ESG](#)

Fonds vs Eurostoxx 50 (E50)

		Meilleur que l'E50	Moins bon que l'E50			Meilleur que l'E50	Moins bon que l'E50
Indicateurs ESG liés à l'Expérience Client				Indicateurs ESG liés à la Réputation			
	Nouveaux produits changement climatique	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>		Engagements contre le travail des enfants	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>
	Emballage responsable	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>		Engagements pour les droits de l'homme	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
	Initiatives en matière de produits biologiques	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>		Engagements éthiques	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
	Utilisation responsable des produits	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>		Engagements protection des données privées	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
	Turnover Employés	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>		Engagements anti-corruption	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
	Accident du travail	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>		Politique ESG envers les sous-traitants	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>
	Croissance du nombre d'employés	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>		% Déchets recyclés	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
	Ecart salarial entre CEO et employé	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>		Politique de biodiversité	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>
	Rémunération liée à des critères ESG	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>		Montant moyen d'amendes environnementales*	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
	Nombre d'heures de formation/employé	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>		Initiatives de restauration environnementale	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>

Indicateurs ESG liés au Bien Commun

	Séparation des pouvoirs entre président et CEO	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>		% Femmes employées	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
	% comité RSE	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>		% Femmes administratrices	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>
	Emissions de CO2 totales (Scopes 1, 2 et 3)	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>		Consommation d'énergie	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
	Emissions CO2 Scope 3	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>		Intensité énergétique/CA	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
	Réduction impact environnemental	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>		Eau rejetée*	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
	Taux annuel moyen de réduction des émissions	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>		Eau utilisée/CA	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
					Consommation totale d'énergie renouvelable	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

* Données portant sur moins de 50% du portefeuille ou de l'indice de référence - Sources : Refinitiv, CDP

Risques ISR : Controverses

Gouvernance :

Deutsche Telekom :

L'entreprise de télécommunication allemande a été victime en novembre dernier d'une campagne d'espionnage diligenté par une agence de renseignement chinoise.

Michelin :

Fermeture des usines de Cholet et de Vannes d'ici 2026. (Risque de disparition de près de 1250 emplois).

Engagements



Climate Action 100+ : Suivi de 7 sociétés, dont 3 (Saint-Gobain, Air Liquide & Carrefour) en tant que porte-parole de la coalition



Dialogue avec les entreprises : En 2024, nous sommes rentrés en dialogue avec 21 entreprises présente dans le fonds au cours de l'année, soit 44% des entreprises investies.

Le process ROC (Return on Customer), basé sur le critère de la Satisfaction Client, est présenté de façon détaillée sur une page dédiée du site internet de Trusteam Finance et dans le Code de Transparence des fonds. Les limites méthodologiques du process ROC sont liées à la qualité et le degré de complétude des données obtenues sur les clients et sur les sociétés, variables selon les sociétés, les secteurs d'activité et les zones géographiques. Le lien entre le critère de la Satisfaction Client et la performance financière des entreprises repose sur des études académiques qui sont présentées de façon détaillée dans le Livre Blanc de Trusteam Finance, qui est disponible gratuitement sur demande. Les politiques ESG (dont la politique d'engagement actionnarial), les reportings extra-financiers des fonds Trusteam et autres reporting ESG (Rapport 29 LEC, Codes de Transparence, Rapports sur la mesure d'impact ISR, compte rendu sur la politique de vote et d'engagement) sont disponibles sur le site internet de Trusteam Finance. Plus d'informations sur : <https://www.trusteam.fr/nos-engagements/>