

Fonds thématiques globaux

Performance ESG – Rapport 2023

CONTEXTE

Dans le cadre de la labellisation ISR de ses produits, Thematics AM a pris l'engagement de communiquer aux investisseurs des indicateurs leur permettant d'appréhender les risques que représente l'ESG au sein des portefeuilles (voir notre Code de transparence : <https://thematics-am.net/4baQxhd>)

Pour assurer la continuité du suivi de cette stratégie, les indicateurs ESG, tels que définis par Thematics AM, ont été recalculés sur la base des positions historiques du fonds, et des scores historiques des sociétés en portefeuille, et sont présentés dans ce rapport.

Le présent Rapport a pour objet la publication récapitulative de l'évolution dans le temps des indicateurs de performance ESG des fonds globaux gérés par Thematics AM. En plus de ce rapport concis sur l'évolution chiffrée des indicateurs, nous vous invitons à consulter notre rapport « Être responsable » qui développe et illustre ces données : <https://thematics-am.net/3Qj9Wou>

METHODOLOGIE

Couverture

Comme pour toute analyse, il est important de connaître le taux de couverture des titres pour les différentes informations recueillies, afin de pouvoir identifier la pertinence des indicateurs calculés à l'échelle du portefeuille. C'est à cet effet que nous utilisons des données externes (Sustainalytics), qui nous permettent d'obtenir un taux de couverture élevés de nos portefeuilles, mais aussi de leurs univers d'investissement.

Indicateur Environnemental - Controverse Environnementale (2è indicateur, couverture >70%)

Le niveau de controverse environnementale pour chaque entreprise est défini comme le niveau maximal de controverse (entre 0 et 5) entre les 3 catégories suivantes de Sustainalytics :

- E.1.12 Operations Incidents
- E.2.2 Environmental Supply Chain Incidents
- E.3.2 Product & Service Incidents

Nous devons surperformer les univers d'investissement respectifs de chaque fonds (et le MSCI ACWI PAB pour le fonds Thematics Climate Selection) sur cet indicateur.

Indicateur Social - Controverse Sociale

Le niveau de controverse sociale pour chaque entreprise est défini comme le niveau maximal de controverse (entre 0 et 5) entre les 4 catégories suivantes de Sustainalytics :

- S.1.7 Employee Incidents
- S.2.3 Social Supply Chain Incidents
- S.3.3 Customer Incidents
- S.4.3 Society & Community Incidents

Indicateur de Gouvernance - Controverse de Gouvernance (1^{er} indicateur, couverture >90%)

Le niveau de controverse de gouvernance pour chaque entreprise est défini comme le niveau maximal de controverse (entre 0 et 5) entre les 3 catégories suivantes de Sustainalytics :

- G.1.5 Business Ethics Incidents
- G.2.13 Governance Incidents
- G.3.4 Public Policy Incidents

Nous devons surperformer les univers d'investissement respectifs de chaque fonds (et le MSCI ACWI PAB pour le fonds Thematics Climate Selection) sur cet indicateur.

Indicateur de Droits Humains – PAI 11

L'indicateur de Droits Humains utilisé est la principale incidence négative numéro 11 définie dans la Sustainable Finance Disclosure Regulation de l'Union Européenne :

« Absence de processus et de mécanismes de contrôle de la conformité aux principes du Pacte mondial des Nations unies et aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des multinationales. »

Nous utilisons les données de Sustainalytics, et nous utilisons la somme des poids dont la valeur est vraie.

		30/06/2022				30/12/2022				30/06/2023				31/12/2023			
		Portefeuille		Univers		Portefeuille		Univers		Portefeuille		Univers		Portefeuille		Univers	
Thematics Wellness Fund	Indicateur	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert
	Environnement	0.66	100%	0.71	99%	0.67	100%	0.63	100%	0.6	97%	0.54	98%	0.51	98%	0.55	98%
	Social	1.79	100%	1.86	99%	1.8	100%	1.76	100%	1.69	97%	1.77	98%	1.63	98%	1.78	98%
	Gouvernance	1.09	100%	1.26	99%	1.07	100%	1.15	100%	1.07	97%	1.18	98%	0.99	98%	1.18	98%
	Droits Humains	60.4%	95%	56.0%	89%	61.2%	96%	58.7%	90%	57.2%	93%	51.2%	87%	57.7%	93%	64.2%	87%

		Portefeuille		Univers		Portefeuille		Univers		Portefeuille		Univers		Portefeuille		Univers	
Thematics Europe Selection Fund	Indicateur	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert
	Environnement	1.04	74%	1.81	99%	0.56	100%	1.82	100%	0.55	99%	1.82	100%	0.5	99%	1.81	99%
	Social	1.72	74%	1.74	99%	1.13	100%	1.72	100%	1.08	99%	1.71	100%	1.08	99%	1.74	99%
	Gouvernance	1.2	74%	1.35	99%	0.76	100%	1.31	100%	0.87	99%	1.33	100%	0.91	99%	1.35	99%
	Droits Humains	43.8%	93%	42.3%	78%	59.8%	99%	29.4%	95%	58.6%	97%	28.7%	96%	59.9%	97%	52.0%	76%

		Portefeuille		Univers		Portefeuille		Univers		Portefeuille		Univers		Portefeuille		Univers	
Thematics Climate Selection Fund	Indicateur	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert
	Environnement	0.47	98%	0.62	99%	0.66	100%	0.7	99%	0.51	97%	0.62	99%	0.46	98%	0.59	97%
	Social	1.24	98%	1.89	99%	1.57	100%	1.86	99%	1.33	97%	1.86	99%	1.22	98%	1.82	97%
	Gouvernance	0.78	98%	1.37	99%	0.89	100%	1.36	99%	0.7	97%	1.36	99%	0.8	98%	1.31	97%
	Droits Humains	65.5%	94%	63.6%	90%	61.0%	99%	67.3%	94%	63.0%	95%	63.2%	92%	66.6%	94%	71.1%	89%

		Portefeuille		Univers		Portefeuille		Univers		Portefeuille		Univers		Portefeuille		Univers	
Thematics AI & Robotics Fund	Indicateur	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert
	Environnement	0.15	100%	0.24	96%	0.15	98%	0.19	97%	0.15	98%	0.23	97%	0.15	98%	0.28	97%
	Social	0.66	100%	1.03	96%	0.58	98%	0.88	97%	0.53	98%	0.94	97%	0.53	98%	0.99	97%
	Gouvernance	0.47	100%	0.71	96%	0.48	98%	0.63	97%	0.49	98%	0.67	97%	0.53	98%	0.72	97%
	Droits Humains	74.2%	98%	54.9%	85%	71.1%	99%	58.8%	89%	67.5%	98%	60.0%	89%	73.4%	97%	57.1%	88%

		Portefeuille		Univers		Portefeuille		Univers		Portefeuille		Univers		Portefeuille		Univers	
Thematics Safety Fund	Indicateur	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert
	Environnement	0.24	98%	0.33	92%	0.23	100%	0.34	94%	0.24	100%	0.3	93%	0.18	100%	0.31	95%
	Social	0.87	98%	1.22	92%	0.85	100%	1.14	94%	0.82	100%	1.13	93%	0.8	100%	1.17	95%
	Gouvernance	0.52	98%	0.62	92%	0.54	100%	0.68	94%	0.49	100%	0.67	93%	0.48	100%	0.68	95%
	Droits Humains	71.3%	88%	54.0%	80%	69.9%	90%	57.8%	81%	70.6%	90%	57.7%	81%	73.2%	91%	60.4%	82%

		Portefeuille		Univers		Portefeuille		Univers		Portefeuille		Univers		Portefeuille		Univers	
Thematics Water Fund	Indicateur	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert
	Environnement	0.49	98%	0.64	96%	0.48	98%	0.54	97%	0.47	99%	0.56	97%	0.49	96%	0.55	95%
	Social	0.92	98%	1.04	96%	0.96	98%	0.91	97%	0.99	99%	0.99	97%	0.92	96%	0.94	95%
	Gouvernance	0.39	98%	0.49	96%	0.41	98%	0.44	97%	0.41	99%	0.47	97%	0.41	96%	0.44	95%
	Droits Humains	69.0%	87%	56.2%	84%	70.0%	88%	54.6%	80%	67.3%	85%	57.0%	81%	67.6%	84%	56.8%	81%

		Portefeuille		Univers		Portefeuille		Univers		Portefeuille		Univers		Portefeuille		Univers	
Thematics Subscription Economy Fund	Indicateur	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert	Valeur	Couvert
	Environnement	0.19	97%	0.61	96%	0.19	97%	0.52	97%	0.21	96%	0.53	97%	0.29	96%	0.53	98%
	Social	1.27	97%	1.79	96%	1.26	97%	1.54	97%	1.29	96%	1.58	97%	1.3	96%	1.59	98%
	Gouvernance	0.68	97%	1.14	96%	0.65	97%	0.96	97%	0.71	96%	1	97%	0.72	96%	1	98%
	Droits Humains	80.9%	95%	65.4%	85%	75.1%	93%	64.6%	89%	73.2%	93%	60.0%	89%	70.6%	92%	65.3%	87%