

## EPARGNE ETHIQUE FLEXIBLE - H Notation ESG du portefeuille au 28/06/2024



## Méthodologie PRISME

Pour les entreprises, la méthodologie propriétaire PRISME repose sur les 3 principes suivants.

- Notation propriétaire PRISME: L'évaluation de la performance ESG des émetteurs repose sur une approche « best in universe » et se fonde sur la note PRISME des émetteurs (comprise entre 0 et 10). Cette note inclut l'évaluation ESG des émetteurs fournie par Moody's ESG Solutions et donne la priorité à l'impact réel des politiques ESG des émetteurs en surpondérant les critères de résultats et 9 critères à fort impact ESG (3 par domaine E, S et G). Les émetteurs sont repartis en déciles selon leur note PRISME.
- Stratégie d'exclusions : sont exclus du périmètre d'investissement les Etats désignés comme des paradis fiscaux, les émetteurs dont le siège social est enregistré dans un paradis fiscal et les entreprises impliquées dans la production d'armes controversées, les jeux d'argent, le tabac, les pesticides, le charbon, le pétrole, le gaz et les énergies fossiles non conventionnelles.
- Analyse des controverses : les sociétés impliquées dans des controverses ESG, incidents dont la gravité est évaluée sur une échelle de 1 (faible) à 5 (fort), ainsi que les Etats ne faisant pas preuve de la mise en place du cadre législatif et social suffisant au développement de la démocratie sont exclus.

Les fonds ISR d'Ecofi intègrent l'intensité carbone (calculée avec les émissions scope 1, 2 et 3) dans leur objectif de gestion en veillant à ce qu'elle soit systématiquement inférieure à celle de leur univers ESG.

#### Indicateurs ESG du portefeuille

Note PRISME globale 6.2/10

Note PRISME corporate 6.23/10

Note PRISME pays 0/10

Intensité carbone 1188.8 t CO2eq/M€ CA

Empreinte carbone 4188 t CO2eq

CA aligné avec la taxonomie verte UE 5.5%

Actif aligné avec le scénario SDS (1,5°) 88.95%

Actif investi en green/social/sust bonds 4%

Classement SFDR Article 8



						■ a térueulque raança de				
Emetteurs	Code ISIN	Décile	Note PRISME	Niveau controverse	Emissions de gaz à effet de serre (t.eq CO2)	Intensité Carbone (t CO2eq/M€ CA)	Type de valeur	Green/Social /Sust Bond	CA aligné avec la taxonomie verte UE	% Actif
ABN AMRO BANK NV	XS2573331837	1	6.5	3	19753110	1961.4	Bonds	-	-	1,0%
AIR LIQUIDE	FR0000120073	1	6.2	3	58612000	2511.8	Stocks	-	-	0,6%
AIRBUS SE	NL0000235190	1	6.5	3	476919142	9145.3	Stocks	-	-	0,8%
AKZO NOBEL	NL0013267909	1	6.1	3	15166610	1582	Stocks	-	-	0,4%
ALD SA	FR001400D7M0	1	6.5	0	4158515	398.3	Bonds	-	-	1,1%
AMADEUS IT	ES0109067019	1	6.1	0	509479.5	190.8	Stocks	-	-	0,5%
AMOUNDI SA	FR0004125920	1	7.2	3	1262049.3	216.5	Stocks	-	-	0,5%
ANHEUSER-BUSCH INBEV	BE0974293251	6	4	3	30938162.6	673.4	Stocks	-	-	0,5%
ARVAL SERVICE LEASE SA/F	FR00140019F5	1	6.6	3	36166804.6	335.5	Bonds	-	-	2,1%
ASM INT	NL0000334118	2	5.4	0	883021.4	510.4	Stocks	-	-	1,0%
ASM LITHOGRAPHY	NL0010273215	1	6.4	0	11964010	642.8	Stocks	-	-	2,2%
ASR NEDERLAND	NL0011872643	1	6.6	0	2056743.4	210.5	Stocks	-	-	0,5%
AXA	FR0000120628	1	6.9	3	23289693.5	210.5	Stocks	-	-	1,0%
BANCO SANTANDER	ES0113900J37	1	6.3	3	33807322.4	511.2	Stocks	-	-	0,7%
BANCO SANTANDER	XS2538366878	1	6.3	3	33807322.4	511.2	Bonds	-	-	2,1%
BANK OF IRELAND GROUP PLC	IEOOBD1RP616	2	5.5	3	2367193.3	334.4	Stocks	-	-	0,4%
BBVA	ES0113211835	1	6.7	2	21217903.5	598.8	Stocks	-	-	0,7%
BEIERSDORF	DE0005200000	3	5	3	3065989	402	Stocks	-	-	0,4%
BELFIUS BANK	BE0002993740	2	5.6	3	2049680.2	335.5	Bonds	-	-	2,1%
BIOMERIEUX	FR0013280286	1	6.4	0	1098000	325.2	Stocks	-	-	0,8%
BMW	DE0005190003	3	4.8	3	122539929	1101.6	Stocks	-	-	0,5%
BNP PARIBAS	FR0000131104	1	6.6	3	36166804.6	335.5	Stocks	-	-	0,9%
BOUYGUES	FR0000120503	1	6.4	3	20944501	557.2	Stocks	-	-	0,5%
BOUYGUES	FR001400AJX2	1	6.4	3	20944501	557.2	Bonds	-	-	2,0%
BUREAU VERITAS	FR0006174348	1	7	0	637513	128	Stocks	-	-	0,4%
CAIXA BANK	XS2346253730	1	7	3	21396401	1520.3	Bonds	-	-	1,9%
CASSA DEPOSITI PRESTITI	IT0005422032	1	7.3	3	9188395.6	335.4	Bonds	-	-	1,9%
COVESTRO	DE0006062144	1	6.4	0	27262200	1714.3	Stocks	-	-	0,7%
CREDIT MUTUEL ARKEA	FR00140065E6	1	6.5	2	6636871.6	332.1	Bonds	-	-	1,7%
DASSAULT SYSTEMES	FR0014003TT8	1	6.7	0	673286.5	138.5	Stocks	-	-	0,4%
DHL GROUP	DE0005552004	1	7	3	45100000	551.7	Stocks	-	-	0,9%
DSM-FIRMENICH AG	CH1216478797	1	6.4	3	12916000	1403.3	Stocks	-	-	0,3%
E.ON	DEOOOENAG999	1	6.2	3	109817359.4	1419.6	Stocks	-	-	0,6%
EDENRED	FR0013444395	1	6.9	3	185648.5	117.3	Bonds	-	-	1,3%
ENAGAS	ES0130960018	1	7.4	0	1088776	1106.2	Stocks	-	-	0,4%
ERSTE BANK	AT 0000652011	1	6.4	0	3221280.9	332.8	Stocks	-	-	1,0%
ESSILORLUXOTTICA	FR0000121667	1	6	3	13078508.1	659.9	Stocks	-	-	0,4%
EUREX	SX5E 07/19/24 P4825	-	-	0	2483540.4	289.5	Option	-	-	0,1%
EVONIK INDUSTRIES	DEOOOEVNK013	1	6.4	2	29601600	1979.4	Stocks	-	-	0,9%



## EPARGNE ETHIQUE FLEXIBLE - H Notation ESG du portefeuille au 28/06/2024



### Méthodologie PRISME

Pour les entreprises, la méthodologie propriétaire PRISME repose sur les 3 principes suivants.

- Notation propriétaire PRISME: L'évaluation de la performance ESG des émetteurs repose sur une approche « best in universe » et se fonde sur la note PRISME des émetteurs (comprise entre 0 et 10). Cette note inclut l'évaluation ESG des émetteurs fournie par Moody's ESG Solutions et donne la priorité à l'impact réel des politiques ESG des émetteurs en surpondérant les critères de résultats et 9 critères à fort impact ESG (3 par domaine E, S et G). Les émetteurs sont repartis en déciles selon leur note PRISME.
- Stratégie d'exclusions : sont exclus du périmètre d'investissement les Etats désignés comme des paradis fiscaux, les émetteurs dont le siège social est enregistré dans un paradis fiscal et les entreprises impliquées dans la production d'armes controversées, les jeux d'argent, le tabac, les pesticides, le charbon, le pétrole, le gaz et les énergies fossiles non conventionnelles.
- Analyse des controverses : les sociétés impliquées dans des controverses ESG, incidents dont la gravité est évaluée sur une échelle de 1 (faible) à 5 (fort), ainsi que les Etats ne faisant pas preuve de la mise en place du cadre législatif et social suffisant au développement de la démocratie sont exclus.

Les fonds ISR d'Ecofi intègrent l'intensité carbone (calculée avec les émissions scope 1, 2 et 3) dans leur objectif de gestion en veillant à ce qu'elle soit systématiquement inférieure à celle de leur univers ESG.

#### Indicateurs ESG du portefeuille

Note PRISME globale 6.2/10

Note PRISME corporate 6.23/10

Note PRISME pays 0/10

Intensité carbone 1188.8 t CO2eq/M€ CA

Empreinte carbone 4188 t CO2eq

CA aligné avec la taxonomie verte UE 5.5%

Actif aligné avec le scénario SDS (1,5°) 88.95%

Actif investi en green/social/sust bonds 4%

Classement SFDR Article 8



						* * téruelique raniçaise				
Emetteurs	Code ISIN	Décile	Note PRISME	Niveau controverse	Emissions de gaz à effet de serre (t.eq CO2)	Intensité Carbone (t CO2eq/M€ CA)	Type de valeur	Green/Social /Sust Bond	CA aligné avec la taxonomie verte UE	% Actif
FERRARI	NL0011585146	3	5	2	624780	146.3	Stocks	-	-	1,0%
FNAC DARTY	FR0014002J02	1	6.5	3	4296519	534.2	Bonds	-	-	1,8%
FREENET	DE000A0Z2ZZ5	5	4.4	0	364516.5	142.6	Stocks	-	-	0,5%
FRESENIUS SE	DE0005785604	4	4.7	3	16875778.9	455.2	Stocks	-	-	0,5%
GAZTRANSPORT	FR0011726835	4	4.8	0	118608.4	376.9	Stocks	-	-	0,5%
GENERALI	IT0000062072	1	7	3	10393964	120.3	Stocks	-	-	0,3%
HANNOVER RE	DE0008402215	3	5.1	0	5645256.8	210.5	Stocks	-	-	0,9%
HEINEKEN	NL0000009165	2	5.8	3	18694278	844.5	Stocks	-	-	0,7%
HEINEKEN HOLDING	NL0000008977	2	5.5	3	22071873.5	1006	Stocks	-	-	0,4%
HERMES	FR0000052292	1	7	2	527457	58.7	Stocks	-	-	1,2%
IBERDROLA	ES0144580Y14	1	7.4	3	65900067	1684.8	Stocks	-	-	1,4%
IBERDROLA FINANZAS SAU	XS2557565830	1	7.4	3	65900067	1684.8	Bonds	OUI	-	2,1%
ILIAD	FR0014001YB0	4	4.6	3	1168543.9	154	Bonds	-	-	1,9%
INDITEX	ES0148396007	1	7.2	3	17160146	619.1	Stocks	-	-	1,2%
INFINEON	DE0006231004	1	6.4	0	2183945	197.5	Stocks	-	-	0,4%
INTESA	IT0000072618	1	7	2	63503823	1553.3	Stocks	-	-	0,7%
INTESA	XS2304664597	1	7	2	63503823	1553.3	Bonds	-	-	2,2%
KBC BANK	BE0003565737	1	6.8	0	4236313.3	335.5	Stocks	-	-	0,6%
KERING	FR0000121485	1	7.4	3	2381990	135	Stocks	-	-	0,6%
KINGSPAN GROUP	IE0004927939	5	4.4	2	7259957	1117.4	Stocks	-	-	0,5%
KLEPIERRE	FR0014000KT3	1	6.9	0	1000382	755.1	Bonds	-	-	0,9%
L'OREAL	FR0000120321	1	7.5	3	12528203	388	Stocks	-	-	0,8%
LEG IMMOBILIEN	DE000A289T23	2	5.6	0	2038692.1	2095.5	Bonds	-	-	1,8%
LEGRAND	FR0010307819	1	6.7	3	3605548	515.5	Stocks	-	-	0,5%
LEONARDO	IT0003856405	1	6.5	3	1996414.2	141.2	Stocks	-	-	0,5%
LVMH	FR0000121014	1	6.5	3	6083933	94.7	Stocks	-	-	1,7%
MICHELIN (CGEM)	FR001400AJ45	1	7.2	2	147559305	6201.3	Stocks	-	-	0,6%
MTU AERO ENGINES	DE000A2YPE76	5	4.3	0	9350376.4	2232.7	Bonds	-	-	2,9%
NEXI SPA	IT0005366767	2	5.7	0	20955	6.9	Stocks	-	-	0,4%
NEXITY	FR0013321429	1	6.3	0	1069668	239.4	Bonds	-	-	3,1%
NN GROUP	NL0010773842	2	5.7	3	3977310.7	210.5	Stocks	-	-	0,6%
NOKIA	FI0009000681	1	6.7	0	41462545	1867.5	Stocks	-	-	1,0%
NORDEA BANK ABP	F14000297767	1	6.5	3	3825559.8	335.4	Stocks	-	-	1,0%
PLASTIC OMNIUM	FR0014000LD1	2	5.4	0	32726110	4524.4	Bonds	-	-	1,0%
RANDSTADT	NL0000379121	1	6.4	0	4537584.2	184.2	Stocks	-	-	0,5%
RENAULT	FR0000131906	1	7	3	72692478	1573	Stocks	-	-	0,6%
REXEL	XS2655993033	1	6.7	3	32823364	2234.4	Bonds	-	-	1,1%
SAFRAN	FR0000073272	1	6.1	3	62742436	4146.1	Stocks	-	-	0,9%
SAFRAN	FR0014003Z32	1	6.1	3	62742436	4146.1	Bonds	-	-	2,7%



# EPARGNE ETHIQUE FLEXIBLE - H Notation ESG du portefeuille au 28/06/2024



### Méthodologie PRISME

Pour les entreprises, la méthodologie propriétaire PRISME repose sur les 3 principes suivants.

- Notation propriétaire PRISME: L'évaluation de la performance ESG des émetteurs repose sur une approche « best in universe » et se fonde sur la note PRISME des émetteurs (comprise entre 0 et 10). Cette note inclut l'évaluation ESG des émetteurs fournie par Moody's ESG Solutions et donne la priorité à l'impact réel des politiques ESG des émetteurs en surpondérant les critères de résultats et 9 critères à fort impact ESG (3 par domaine E, S et G). Les émetteurs sont repartis en déciles selon leur note PRISME.
- Stratégie d'exclusions : sont exclus du périmètre d'investissement les Etats désignés comme des paradis fiscaux, les émetteurs dont le siège social est enregistré dans un paradis fiscal et les entreprises impliquées dans la production d'armes controversées, les jeux d'argent, le tabac, les pesticides, le charbon, le pétrole, le gaz et les énergies fossiles non conventionnelles.
- Analyse des controverses : les sociétés impliquées dans des controverses ESG, incidents dont la gravité est évaluée sur une échelle de 1 (faible) à 5 (fort), ainsi que les Etats ne faisant pas preuve de la mise en place du cadre législatif et social suffisant au développement de la démocratie sont exclus.

Les fonds ISR d'Ecofi intègrent l'intensité carbone (calculée avec les émissions scope 1, 2 et 3) dans leur objectif de gestion en veillant à ce qu'elle soit systématiquement inférieure à celle de leur univers ESG.

### Indicateurs ESG du portefeuille

Note PRISME globale 6.2/10

Note PRISME corporate 6.23/10

Note PRISME pays 0/10

Intensité carbone 1188.8 t CO2eq/M€ CA

Empreinte carbone 4188 t CO2eq

CA aligné avec la taxonomie verte UE 5.5%

Actif aligné avec le scénario SDS (1,5°) 88.95%

Actif investi en green/social/sust bonds 4%

Classement SFDR Article 8



Emetteurs	Code ISIN	Décile	Note PRISME	Niveau controverse	Emissions de gaz à effet de serre (t.eq CO2)	Intensité Carbone (t CO2eq/M€ CA)	Type de valeur	Green/Social /Sust Bond	CA aligné avec la taxonomie verte UE	% Actif	
SAP	DE0007164600	1	6.3	3	10200384	366.4	Stocks	-	-	2,0%	
SARTORIUS BIOTECH	FR0013154002	3	5	0	1692165.5	586.1	Stocks	-	-	0,5%	
SCHNEIDER	FR0000121972	1	7.2	3	69168915.6	2393	Stocks	-	-	1,7%	
SCOR (REGROUPE)	FR0010411983	1	6.3	0	3069750.7	210.5	Stocks	-	-	0,4%	
SIEMENS	DE0007236101	2	5.7	3	469864922	7546.2	Stocks	-	-	1,5%	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	DE000SHL1006	4	4.6	0	7623782.2	423.6	Stocks	-	-	0,7%	
SOCIETE GENERALE	FR0000130809	1	6.7	3	17227445.2	335.5	Stocks	-	-	0,5%	
SOCIETE GENERALE	FR0013536661	1	6.7	3	17227445.2	335.5	Bonds	OUI	-	1,9%	
SODEXO	FR0000121220	1	6.6	3	12253419.9	703.1	Stocks	-	-	0,6%	
SOITEC	FR0014000105	1	5.8	0	249630	289.3	Bonds	-	-	1,7%	
TENARIS	LU2598331598	4	4.7	3	13529991.8	2452.3	Stocks	-	-	1,0%	
TERNA	IT0003242622	1	7.6	0	5075992	2002.8	Stocks	-	-	0,6%	
UCB	BE0003739530	6	4	0	736004.8	127.4	Stocks	-	-	0,4%	
UMICORE	BE6322623669	1	6	0	25382011	1055.2	Bonds	-	-	2,0%	
UNIBAIL RODAMCO WESTFIELD	FR0014000UC8	1	6.8	0	2844964	1129.1	Bonds	-	-	1,0%	
UNICREDIT	IT0005239360	1	6.6	3	7841237.7	333.6	Stocks	-	-	0,7%	
VINCI SA (EX SGE)	FR0000125486	1	6.5	3	43178737	863.9	Stocks	-	-	0,4%	
VONOVIA	DE000A3MP4U9	3	5	1	4158775.1	766.4	Bonds	-	-	1,8%	
WARTSILA B	FI0009003727	3	4.8	3	5509928.6	1153.2	Stocks	-	-	0,5%	