

## ECOFI SMART TRANSITION - C

### Notation ESG du portefeuille au 31/12/2024





#### 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 qaz 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 6.3/10

Note PRISME corporate 6.29/10

Note PRISME pays 8.3/10

Intensité carbone 964.9 t CO2eq/M€ CA

Empreinte carbone 17776 t CO2eq

CA aligné avec la taxonomie verte UE 3.9%

Actif aligné avec le scénario SDS (1,5°) 99.9%

Actif investi en green/social/sust bonds 0%

Classement SFDR Article 9



						W B METHODOL PRANCES					
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	
ASM INT	NL0000334118	2	5.4	0	883021.4	510.4	Stocks	-	-	2,8%	
ASM LITHOGRAPHY	NL0010273215	1	6.4	0	11964010	642.8	Stocks	-	-	4,4%	
AXA	FR0000120628	1	6.8	3	23289693.5	210.5	Stocks	-	-	3,8%	
BANCO BPM	IT0005218380	1	6.4	3	1519137.4	329.2	Stocks	-	-	1,3%	
BANCO SANTANDER	ES0113900J37	1	6.3	3	33807322.4	511.2	Stocks	-	-	1,2%	
BBVA	ES0113211835	1	6.7	3	21217903.5	598.8	Stocks	-	-	3,2%	
BEIERSDORF	DE0005200000	3	5	0	3065989	402	Stocks	-	-	1,1%	
BMW	DE0005190003	4	4.8	3	122539929	1101.6	Stocks	-	15.2%	2,5%	
BNP PARIBAS	FR0000131104	1	6.9	3	36166804.6	335.5	Stocks	-	-	3,2%	
DASSAULT SYSTEMES	FR0014003TT8	1	6.7	0	673286.5	138.5	Stocks	-	33.4%	0,7%	
DEUTSCHE BORSE	DE0005810055	2	5.6	0	1366180.9	295	Stocks	-	-	2,2%	
DHL GROUP	DE0005552004	1	7	3	45100000	551.7	Stocks	-	14.6%	2,3%	
DSM-FIRMENICH AG	CH1216478797	1	6	3	12916000	1403.3	Stocks	-	-	0,8%	
ELISA CORPORATION	FI0009007884	1	5.9	0	207441	103.8	Stocks	-	8.4%	0,6%	
EPARGNE ETHIQUE MONETAIRE I	FR0011048537	1	6.4	3	-	1192.5	Fund	-	-	0,5%	
ERSTE BANK	AT0000652011	1	6.4	0	3221280.9	332.8	Stocks	-	-	1,5%	
ESSILORLUXOTTICA	FR0000121667	2	5.8	3	13078508.1	659.9	Stocks	-	-	2,2%	
EVONIK INDUSTRIES	DE000EVNK013	1	6.4	2	29601600	1979.4	Stocks	-	1%	0,7%	
FERRARI	NL0011585146	3	5.2	2	624780	146.3	Stocks	-	-	2,4%	
GECINA	FR0010040865	1	6.8	0	148754.1	195.2	Stocks	-	-	0,6%	
GENERALI	IT0000062072	1	7.4	3	10393964	120.3	Stocks	-	-	1,9%	
HANNOVER RE	DE0008402215	3	5.1	0	5645256.8	210.5	Stocks	-	-	2,2%	
HERMES	FR0000052292	1	7	2	527457	58.7	Stocks	-	-	4,3%	
HUGO BOSS	DE000A1PHFF7	1	6.1	3	710286	254.9	Stocks	-	-	0,8%	
IMCD NV	NL0010801007	3	5.2	0	3475669.7	1011.8	Stocks	-	-	1,4%	
INDITEX	ES0148396007	1	7.2	3	17160146	619.1	Stocks	-	-	2,0%	
INFINEON	DE0006231004	1	6.4	0	2183945	197.5	Stocks	-	-	2,1%	
INTESA	IT0000072618	1	7.3	3	63503823	1553.3	Stocks	-	-	0,8%	
IPSEN	FR0010259150	3	5	0	54883	19.1	Stocks	-	-	0,7%	
ITALGAS	IT0005211237	1	7.2	0	3699250.9	1762.8	Stocks	-	39.6%	2,0%	
L'OREAL	FR0000120321	1	7.5	3	12528203	388	Stocks	-	-	2,8%	
LEGRAND	FR0010307819	1	6.8	3	3605548	515.5	Stocks	-	8.3%	1,0%	
LVMH	FR0000121014	1	6.6	2	6083933	94.7	Stocks	-	-	4,0%	
MTU AERO ENGINES	DE000A0D9PT0	4	4.8	0	9350376.4	2232.7	Stocks	-	-	1,4%	
MUNICH RE	DE0008430026	1	6.2	0	14542349.3	210.1	Stocks	-	-	0,7%	
NEXI SPA	IT0005366767	1	5.8	0	20955	6.9	Stocks	-	-	1,5%	
NORDEA BANK ABP	FI4000297767	1	6.5	3	3825559.8	335.4	Stocks	-	-	4,1%	
ORANGE	FR0000133308	1	7.1	4	7558665	177.8	Stocks	-	-	2,2%	



# ECOFI SMART TRANSITION - C Notation ESG du portefeuille au 31/12/2024



6.29/10



#### 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 qaz 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 6.3/10

Note PRISME pays 8.3/10

Note PRISME corporate

Intensité carbone 964.9 t CO2eq/M€ CA

Empreinte carbone 17776 t CO2eq

CA aligné avec la taxonomie verte UE 3.9%

Actif aligné avec le scénario SDS (1,5°) 99.9%

Actif investi en green/social/sust bonds 0%

Classement SFDR Article 9



Emetteurs	Code ISIN	Décile	Note PRISME	Niveau controverse		Intensité Carbone (t CO2eq/M€ CA)	Type de valeur	Green/Social /Sust Bond	CA aligné avec la taxonomie verte UE	% Actif
ORION CORPORATION B	FI0009014377	3	5.1	0	574703	553.2	Stocks	-	-	1,1%
PERNOD RICARD	FR0000120693	1	6.2	3	8446298.3	789.3	Stocks	-	-	1,5%
SAFRAN	FR0000073272	1	6.1	3	62742436	4146.1	Stocks	-	-	2,8%
SAP	DE0007164600	1	6.3	3	10200384	366.4	Stocks	-	-	4,9%
SCHNEIDER	FR0000121972	1	7.3	3	69168915.6	2393	Stocks	-	31%	3,8%
SEB	FR0000121709	1	6.7	3	15543758	1928.8	Stocks	-	-	0,5%
SIEMENS	DE0007236101	2	5.7	3	469864922	7546.2	Stocks	1	16.5%	4,4%
SOPRA STERIA GROUP	FR0000050809	1	6.4	2	299615.4	64	Stocks	-	1.1%	0,9%
SYMRISE	DE000SYM9999	1	6	2	2241505	583	Stocks	-	2%	1,6%
UCB	BE0003739530	6	4	0	736004.8	127.4	Stocks	-	-	1,4%
UNICREDIT	IT0005239360	1	6.7	3	7841237.7	333.6	Stocks	-	-	1,1%
WOLTERS KLUWER	NL0000395903	2	5.8	0	891157.8	186.8	Stocks	-	-	2,5%