

MARS 2023

QUESTIONNAIRE ESG



Bienvenue sur le questionnaire AF2i !

Ce questionnaire ESG multi-classes d'actifs est le résultat d'un **travail réalisé sur plusieurs mois par un groupe de travail de l'AF2i regroupant, à ce jour, 15 investisseurs institutionnels** (Abeille Assurances, AG2R-La Mondiale, AGIRC-ARRCO, le groupe Agrica, la Caisse des Dépôts, la CAVP, CCR, l'ERAFP, Malakoff-Humanis, la MACSF, la MAIF, Prepar Vie, SCOR, l'UMR, le groupe VYV) et **en collaboration avec les équipes de recherche ESG du groupe Hexagone**. L'objectif est la création d'un questionnaire de place afin de limiter les envois successifs de questionnaires ESG aux sociétés de gestion, et au bénéfice de l'ensemble des investisseurs institutionnels adhérents à l'AF2i.

Les réponses fournies seront utilisées :

1. Par les investisseurs, afin d'évaluer le positionnement des fournisseurs sociétés de gestion avec lesquels ils travaillent, de pouvoir consolider certaines données au niveau de leur portefeuille global, ainsi qu'à des fins réglementaires.

2. Par l'AF2i et Hexagone afin d'établir une étude globale, permettant de suivre l'évolution de l'intégration de l'extra-financier par les sociétés de gestion.

Ce questionnaire n'est pas réalisé en vue d'un label. Pour rappel, **il a pour objectif de constituer une base de données commune à plusieurs investisseurs institutionnels**. Chacun est ensuite libre de l'utiliser comme il le souhaite, et d'accorder plus ou moins de poids aux différentes questions.

Informations pratiques

Ce questionnaire reprend ainsi un grand nombre de sujets. Néanmoins, **l'objectif n'est pas de cocher toutes les cases** mais de répondre objectivement à chaque question afin d'assurer une meilleure transparence. De plus, le questionnaire a été réalisé avec l'objectif de limiter les réponses rédactionnelles. **Les réponses longues et peu précises sont à proscrire** afin d'éviter les mauvaises interprétations par les lecteurs et ainsi éviter toute contestation par la suite. Merci de répondre uniquement aux questions posées.

Vous pouvez répondre à **ce questionnaire sur plusieurs jours**, pour cela :

- utiliser le même ordinateur (adresse IP) et ne pas être en navigation privée
- cliquer sur le lien, les réponses seront enregistrées.

Vous **pouvez revenir en arrière**, grâce aux flèches grises en bas de l'écran. Une fois le questionnaire soumis, vous ne pouvez plus le modifier.

Pour les questions où les réponses sont à cocher :

- Les listes avec les ronds signifient qu'un seul choix est possible.
- Les listes avec les carrés signifient que plusieurs choix sont possibles.

Pour les questions pour lesquelles un pourcentage est demandé, merci de le renseigner en nombre entier. **Par exemple, si vous souhaitez indiquer 50%, noter 50.**

Les questions de chaque sous-partie ne commencent pas à 1 mais à 2 ou parfois plus (i.e. Q1.5 est la première question de la partie 1). Merci de ne pas en tenir compte, cela vient du système de numérotation de notre logiciel.

Merci de répondre à toutes les réponses sur la même entité légale (et donc le même périmètre) que celle déclarée en début de questionnaire. En cas d'existence de plusieurs entités légales qui gèrent, merci de répondre à plusieurs questionnaires si vous l'estimez nécessaire.

Table des matières

<i>Bienvenue sur le questionnaire AF2i !</i>	1
<i>Informations pratiques.....</i>	1
<i>Première partie : L’extra-financier au sein de la société de gestion.</i>	3
<i>I.1) Description générale de la société de gestion.....</i>	3
<i>I.2) La société de gestion dans la Cité</i>	5
<i>I.3) La RSE au sein de la société de gestion</i>	7
<i>I.4) Organisation, équipes et ressources.....</i>	11
<i>Deuxième partie : Les politiques d’investissement responsable de la société de gestion</i>	16
<i>II.1) La politique ISR : caractéristiques générales</i>	16
<i>II.2) Les politiques climatiques.....</i>	19
<i>II.3) Alignement aux objectifs climatiques</i>	25
<i>II.4) Analyses des risques climatiques, environnementaux et liés à la biodiversité.....</i>	27
<i>II.5) Politique de vote et d’engagement.....</i>	29

Première partie : L'extra-financier au sein de la société de gestion.

I.1) Description générale de la société de gestion

Cette sous-partie n'est pas discriminante mais vise à bien caractériser la catégorie à laquelle appartient votre société de gestion.

Q1.5 Nom de la société de gestion pour laquelle vous remplissez cette enquête (entité légale qui gère).

Q1.6 Personne de la société de gestion à contacter pour toute question relative à ce questionnaire
Prénom, Nom, Fonction, Adresse email

Q1.7 Merci de cocher la case ci-dessous attestant que :

- La société de gestion s'engage à apporter la meilleure qualité de réponse possible au présent questionnaire, ce qui permettra de refléter de la manière la plus exacte possible l'avancement de la société de gestion en la matière.

Q1.8 Merci d'indiquer le code LEI de la société de gestion

Q1.9 A quel endroit la société de gestion est-elle enregistrée (lieu d'agrément) ?

▼ En France (1) ... Autre (8)

Q1.10 **Si autre** : Merci de préciser le pays

Q1.11 Quel est le type d'actionnariat principal de votre société de gestion ? Établissement de crédit ; Entreprises d'assurances et mutuelles ; Personnes physiques ; Prestataires de services d'investissement ; autre.

Q1.12 Que représente la gestion passive en % de vos encours totaux ?

Q1.13 Sur une base 100 merci de répondre au tableau ci-dessous (l'objectif est d'avoir un ordre de grandeur, les valeurs approximatives sont acceptées).

% des fonds dédiés et/ou mandats sous gestion (% fonds totaux)

% des fonds ouverts (% de fonds totaux)

Q1.14 Sur une base 100 merci de répondre au tableau ci-dessous (l'objectif est d'avoir un ordre de grandeur, les valeurs approximatives sont acceptées).

% Fonds ouverts commercialisés en France (% fonds ouverts totaux)	<input type="text"/>
% Fonds ouverts commercialisés en Europe (hors France) (% fonds ouverts totaux)	<input type="text"/>
% Fonds ouverts commercialisés au niveau international (hors France et Europe) (% fonds ouverts totaux)	<input type="text"/>

Q1.15 Quel est / sont les emplacements géographiques de la ou des équipes d'investissements ?

- En France
- Irlande
- Luxembourg
- Zone Euro (hors France, Irlande et Luxembourg)
- Suisse
- Suède
- Norvège
- UK
- USA
- Autre

Q1.16 **Si autre** : Précisez.

Q1.17 Dans quelle(s) classe(s) d'actifs votre société de gestion est-elle spécialisée ?
Actifs cotés, Actifs non cotés, Actifs immobiliers, Actifs cotés et non cotés

Q1.18 Merci de répondre aux éléments demandés ci-dessous.

Exemple, si votre entité gère 50 milliards € d'encours, merci d'écrire dans le champ 50000.

[Cliquer pour modifier la validation](#)

★ Encours totaux au 31 décembre 2022 en millions d'€.	<input type="text"/>
★ Valeur totale de l'ensemble des fonds ouverts au 31 décembre 2022 en millions d'€.	<input type="text"/>

I.2) La société de gestion dans la Cité

Q2.2 Merci de cocher les initiatives dont votre société de gestion fait partie :

- Membre de l'AFG
- Membre de France Invest
- Membre du FIR
- Membre du FAIR
- Membre de l'Institut de la Finance durable (anciennement Finance For Tomorrow)
- Membre de l'EVPA - European Venture Philanthropy Association (EVPA)
- Membre du GIIN - Global Impact Investing Network
- Membre de l'ICGN - International Corporate Governance Network
- Signataire des Principes de l'Equateur (environnemental et social)
- Signataire du TFFP - Tobacco Free Finance Pledge
- Membre de l'Investor Alliance for Human Rights
- Aucun
- Autre

Q2.3 **Si autre** : Merci de préciser au maximum deux autres initiatives que vous avez rejointes que vous trouvez essentielles.

Q2.4 **Si Membre France Invest** : Merci de préciser si votre société de gestion est signataire d'une ou des deux des chartes ci-dessous :

- Signataire de la Charte en faveur de la parité de France Invest
- Signataire de la Charte d'investisseur responsable de France Invest
- Aucun

Q2.5 Merci de préciser si votre société de gestion est signataire des coalitions / chartes ci-dessous :

- Signataire Déclaration de Soutien au Développement de la Finance à Impact de Finance for Tomorrow
- Membre de la coalition pour la Transition Juste de Finance For Tomorrow
- Signataire de la Charte d'Impact de Finance for Tomorrow
- OPIM (Operating Principles for Impact Management)
- Aucun

Q2.6 Merci de renseigner les initiatives climatiques dont votre société de gestion fait partie :

- Membre de la TCFD
- Membre de l'IC20 Initiative Carbone 2020 / IC International
- Membre du Carbon Disclosure Project (CDP)
- Signataire de Climate Action 100+
- Membre de la Net Zero Asset Managers Initiative
- Membre du Groupement des Investisseurs Institutionnels sur le Changement Climatique – Institutional Investors Group on Climate Change (IIGCC) (Europe)
- Membre de l'INCR / Ceres (Amérique du Nord)
- Membre de l'IGCC (Australie et Nouvelle Zélande)
- Membre de l'AIGCC (Asie)
- Montreal Carbon Pledge
- Aucun
- Autre

Q2.7 **Si autre** : Merci de préciser au maximum deux autres initiatives climatiques que vous avez rejointes que vous trouvez essentielles.

Q2.8 Merci de renseigner les initiatives sur la biodiversité dont votre société de gestion fait partie :

- Membre de la TNFD
- Membre du Club CDC Biodiversité B4B+
- Membre du Finance for Biodiversity Foundation
- Signataire du Finance for Biodiversity Pledge
- Membre du Farm Animal Investment Risk and Return (FAIRR)
- Aucun
- Autre

Q2.9 **Si autre** : Merci de préciser une initiative sur la biodiversité que vous jugez importante dont fait partie votre société de gestion.

Q2.10 Merci de renseigner les initiatives sur la diversité / inclusion dont votre société de gestion fait partie :

- Membre du 30% Club
- Membre du 30% Club France Investor Group
- Membre de Access to Medicine Foundation
- Aucun
- Autre

Q2.11 Êtes signataire des UN PRI ? Oui/Non

Q2.12 **Si oui** : En quelle année avez-vous adhéré aux UN PRI ? Format AAAA

Q2.13 **Si oui Q2.11** : Lors de la notation reçue en 2022 sur l'exercice 2020, Combien d'étoiles avez-vous eu au module "Investment & Stewardship Policy" ? 0 étoile... 6 étoiles

Q2.14 **Si oui Q2.11** : Lors de la notation reçue en 2020 sur l'exercice 2019 (ancienne notation), Quelle est votre notation "stratégie et gouvernance" des UNPRI ? A+, A... E

Q2.15 Est-ce que les objectifs de réduction d'émissions de la société de gestion, ainsi que son plan d'action :

- Sont certifiés SBTi
- Ne sont pas encore certifiés SBTi mais le processus de certification a démarré (a minima via une lettre d'engagement signée il y a moins de 24 mois)
- Ne sont pas dans une démarche de certification SBTi

Q2.16 **Si non** : Souhaitez-vous ajouter un commentaire sur la démarche de certification SBTi ?
Merci de répondre de manière synthétique.

Q2.17 Autres notations ou certifications externes sur des sujets ESG /Climat que vous souhaiteriez mentionner ?

I.3) La RSE au sein de la société de gestion

Démarche RSE générale

Q3.2 Disposez-vous d'une démarche RSE formalisée, pour la société de gestion ? Oui/non [**Si non, fin de la sous-partie**].

Q3.3 Dans votre démarche RSE, avez-vous fixé des objectifs d'impact sur les ODD ? Oui/non

Q3.4 **Si oui** : Cochez lesquels et précisez la métrique suivie

	Merci de cocher les ODD en lien avec votre démarche RSE	Merci de préciser les métriques utilisées pour répondre à ces objectifs
Pas de pauvreté (ODD 1)	<input type="radio"/>	<input type="text"/>
Zéro faim (ODD 2)	<input type="radio"/>	<input type="text"/>
Bonne santé et bien être (ODD 3)	<input type="radio"/>	<input type="text"/>
Éducation de qualité (ODD 4)	<input type="radio"/>	<input type="text"/>
Égalité entre les sexes (ODD 5)	<input type="radio"/>	<input type="text"/>

...

Q3.5 Votre société de gestion est-elle une entreprise certifiée Bcorp ? Oui/non

Q3.6 Votre société de gestion est-elle une entreprise à mission ? Oui/non

Q3.7 **Si oui** : précisez votre raison d'être.

Démarche RSE : focus environnement

Q3.8 Avez-vous déjà effectué une évaluation du bilan carbone de la société de gestion ? Oui/non

Q3.9 Fixez-vous des objectifs de réduction du bilan carbone de la SDG ? Oui/non

Q3.10 **Si oui** : Merci de répondre ci-dessous :

Quel est l'objectif de réduction (en %) ? Pour quel horizon ? Quelle est l'année de référence ?

Q3.11 **Si oui Q3.9** : Quels scopes prenez-vous en compte pour ces objectifs de réduction de GES au niveau de la société de gestion ? Liste déroulante : Scopes 1 & 2 / Scopes 1,2 & 3.

Q3.12 Avez-vous une politique de gestion des déchets ? Oui/non

Q3.13 Avez-vous une politique de gestion de l'eau ? Oui/non

Q3.14 Si vous êtes propriétaire, avez-vous ou suivez-vous une politique de rénovation de vos bâtiments ? Oui/non / NA (si non propriétaire)

Q3.15 Avez-vous une politique de mobilité durable ? Oui/non

Q3.16 **Si oui** : merci de cocher les éléments suivants mis en place dans votre politique de mobilité durable :

- Mise à disposition de vélos ou vélos électriques
- Limitation des déplacements en avion
- Arrêts des déplacements en avion en France
- Arrêts des déplacements en avion si une alternative en train est possible à moins de 6h
- Mise à disposition de stations de recharge pour les voitures électriques
- Autre

Q3.17 **Si autre** : Merci de préciser les autres éléments mis en place dans votre politique de mobilité durable (de manière synthétique).

Démarche RSE : focus social

Q3.18 Quel est le taux de départ de la société de gestion ? (Nombre de départ en 2022 / effectif au 01/01/22, exprimé en %).

Q3.19 Jugez-vous votre taux de départ de la société de gestion raisonnable ? Oui/non

Q3.20 Quels enjeux de diversité sont intégrés aux procédures de gestion des ressources humaines (procédure de recrutement, règlement intérieur, autre document pertinent) ?

- Répartition homme - femme
- Diversité des âges
- Accès aux personnes en situation d'handicap
- Autre
- Aucun

Q3.21 **Si autre** : Merci de préciser d'autres critères de diversité (max 2) mis en place au sein de vos équipes.

Q3.22 Merci de répondre aux questions ci-dessous. Si 50% merci de renseigner 50 dans la case correspondante.

Quel est le % de femmes en % de votre effectif total au 31/12/2022 ?	<input type="text"/>
Quel est le % de femmes parmi les ETP consacrés à la gestion / équipe d'investissement (gérants, analystes, fonctions support dédiées à la gestion,...) au 31/12/2022 ?	<input type="text"/>
Quel est le % de femmes parmi les ETP consacrés à l'ESG-Climat au 31/12/2022 ?	<input type="text"/>
Quel est le % de personnes en situation de handicap en % de votre effectif total au 31/12/2022 ?	<input type="text"/>

Q3.23 Merci de répondre ci-dessous.

	Merci de sélectionner la bonne réponse	
	Oui	Non
Le Directeur Général (ou équivalent) de la société de gestion est-il une femme ?	<input type="radio"/>	<input type="radio"/>
Le Président du Conseil d'Administration (ou équivalent) de la société de gestion est-il une femme ?	<input type="radio"/>	<input type="radio"/>

Q3.24 Merci de répondre aux questions ci-dessous, dans la mesure du possible. Si 50% merci de renseigner 50 dans la case correspondante.

Quel est le % de personnes de plus de 50 ans en % de votre effectif total, au 31/12/2022 ?	<input type="text"/>
Quel est le % de personnes entre 40 et 49 ans, en % de votre effectif total, au 31/12/2022 ?	<input type="text"/>
Quel est le % de personnes entre 30 et 39 ans en % de votre effectif total, au 31/12/2022 ?	<input type="text"/>
Quel est le % de personnes en dessous de 30 ans, en % de votre effectif total, au 31/12/2022 ?	<input type="text"/>

Q3.25 Politique de rémunération : existe-t-il un accord d'intéressement et/ou de participation ?
Oui/non

Q3.26 Existe-t-il un dispositif d'actionnariat salarié ? Oui/non

Q3.27 **Si oui** : Quel pourcentage des salariés est actionnaire de la société de gestion ?

Q3.28 Quel pourcentage des salariés est potentiellement intéressé à la performance des fonds via une rémunération variable (hors intéressement et/ou participation) conditionnée à la performance financière ?

Q3.29 Quel pourcentage des salariés est potentiellement intéressé à la performance des fonds via une rémunération variable (hors intéressement et/ou participation) conditionnée à la performance extra-financière ?

Q3.30 Quel est le pourcentage de femmes parmi les 10 profils les mieux rémunérés de la société de gestion (salaire fixe et éléments de prime annuels) ?

Q3.31 Mesurez-vous les écarts de rémunération entre les hommes et les femmes ? Oui/non

Q3.32 **Si oui** : Quel type d'actions entreprenez-vous pour les réduire ?

Q3.33 Votre politique de rémunération intègre-t-elle des critères ESG/ODD/Climat opérationnels (i.e. baisse de la consommation d'énergie, réduire les déplacements, diminution des déchets etc.) ?
Oui/non

Q3.34 **Si oui** : Merci d'en préciser les critères principaux (max 4) ci-dessous :

	Principaux thèmes	
	Liste des critères	Objectifs quantifiés
		Réponse en %
1er critère	<input type="text"/>	<input type="text"/>
2ème critère	<input type="text"/>	<input type="text"/>
3ème critère	<input type="text"/>	<input type="text"/>
4ème critère	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Démarche RSE : focus gouvernance

Q3.35 Quel est le pourcentage de membres indépendants dans le Conseil d'administration (ou équivalent) de la société de gestion ?

Q3.36 Quel est le pourcentage de femmes dans le Conseil d'administration (ou équivalent) de la société de gestion ?

Q3.37 Quel est le pourcentage de femmes au comité de direction de la société de gestion ?

Litiges & incidents

Q3.38 Avez-vous fait face à un ou plusieurs litiges majeurs en ESG depuis 3 ans ? Oui/non

Q3.39 Avez-vous fait face à des incidents ESG, dans le sens faire l'objet de controverse ou de communication négative de quelque nature que ce soit (article de presse négatif, campagne d'une ONG...) au cours de l'année écoulée toutes zones géographiques confondues ? Oui/non

Q3.40 **Si oui** : Merci de le ou les identifier de manière synthétique.

Q3.41 Avez-vous subi une ou plusieurs sanctions AMF depuis 5 ans ? Oui/non

Q3.42 **Si oui** : Merci de préciser les raisons de ou des sanctions reçues par l'AMF ainsi que leurs dates.

Q3.43 Avez-vous subi une ou plusieurs condamnations pour litiges depuis 5 ans ? Oui/non

Q3.44 **Si oui** : Merci de préciser les raisons de ou des sanctions reçues ainsi que leurs dates.

I.4) Organisation, équipes et ressources

Organisation des équipes d'investissements et ISR

Q4.2 Comment est intégré l'ESG au sein des équipes d'investissement (hors équipes reportings) ? Choisir parmi la liste :

Les équipes d'investissement ne sont pas formées à l'ESG et il n'y a pas d'équipe ESG dédiées à part.

100% des équipes d'investissement existantes sont formées sur ces sujets ESG et il n'y a pas d'équipe dédiée à part

Une partie des équipes d'investissement existantes est formée sur les sujets ESG et il n'y a pas d'équipe dédiée à part

Une équipe dédiée spécialisée autonome a été mise en place qui porte seule les sujets ESG

Une équipe dédiée spécialisée autonome et une partie des équipes d'investissement existantes est formée sur les sujets ESG

Une équipe dédiée spécialisée autonome et 100% des équipes d'investissement existantes sont formés sur ces sujets ESG

Autre

Q4.3 A quelle direction/service est rattachée la recherche/analyse ESG ?

Choisir parmi la liste :

Direction générale

Direction des investissements

Direction des risques

Autre

Q4.4 **Si autre** : Merci de préciser à quel service se rattache la recherche / analyse ESG ?

Ressources humaines déployées

Q4.5 Au 31/12/2022, toutes succursales confondues merci de répondre aux éléments ci-dessous :

Effectif total de la société de gestion	<input type="text"/>
Nombre total d'équivalent temps plein (ETP) dans les équipes d'investissement (gérants, analystes, fonctions supports dédiées à la gestion)	<input type="text"/>
Dont nombre total d'ETP gérants financiers	<input type="text"/>
Nombre total d'ETP en charge des sujets ESG	<input type="text"/>
Dont nombre total d'ETP analystes ESG	<input type="text"/>
Dont nombre total d'ETP en charge des reportings extra-financiers	<input type="text"/>
Dont nombre total d'ETP dédiés au vote actionnarial	<input type="text"/>

Q4.6 Publiez-vous de la recherche sur des sujets ESG ? Oui/non

Q4.7 **Si oui** : Merci de renseigner le lien vers ces documents de recherche.

Q4.8 Avez-vous noué des partenariats avec la recherche académique ? Oui/non

Q4.9 **Si oui** : Merci de lister ces partenariats et les sujets qu'ils concernent.

Q4.10 Les salariés de votre société de gestion ont-ils reçu des formations ESG ? Oui/non

Q4.11 **Si oui** : Quelle est la part au 31/12/2022 des salariés ayant reçu une formation ESG depuis moins de 2 ans (en % du nombre total de salariés) ?

Q4.12 **Si oui Q4.10** : Merci de remplir les principales formations (max 4) autour des sujets ESG réalisées par les salariés sur les deux dernières années.

	Options de colonnes ▾	Options de colonnes ▾	Options de colonnes ▾	Options de colonnes ▾
	Formations dispensées	Date de la formation	Impact de la formation	Représentativité des salariés
	Nom / thématique	Mois et année	% des salariés concernés	Profils des salariés ayant reçu la formation
Formation 1	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Formation 2	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Formation 3	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Formation 4	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Q4.13 Merci de répondre aux éléments ci-dessous :

*Définition équipe d'investissement : gérants, analystes, fonctions supports dédiées à la gestion.

% des personnes membres des équipes
d'investissement ayant reçu l'accréditation AMF-
ESG

% des personnes membres des équipes
d'investissement ayant reçu l'accréditation CFA-
ESG

Fournisseurs de données

Q4.14 Utilisez-vous des données ESG-Climat externes ? Oui/non [**Si non, passage à Q4.23**]

Q4.15 Quels fournisseurs de données externes utilisez-vous pour les données ESG (à l'exception des questions liées à l'empreinte carbone/calcul de température) ?

- MSCI ESG Research
- Sustainalytics / Morningstar
- Bloomberg
- Ethifinance
- Moody's (Vigeo)
- FTSE Russel (Beyond Rating)
- ISS
- Autre
- Aucun

Q4.16 **Si autre** : Merci de préciser les fournisseurs de données principaux que vous utilisez qui ne sont pas présents dans la liste précédente :

Fournisseur ESG autre 1

Fournisseur ESG autre 2

Q4.17 Quels fournisseurs de données externes utilisez-vous pour les controverses ?

- MSCI ESG Research
- Sustainalytics / Morningstar
- Bloomberg
- Moody's (Vigeo)
- ISS
- Autre
- Aucun

Q4.18 **Si autre** : Merci de préciser les fournisseurs de données principaux que vous utilisez qui ne sont pas présents dans la liste précédente :

Fournisseur controverses autre 1

Fournisseur controverses autre 2

Q4.19 Quels fournisseurs de données externes utilisez-vous pour calculer l'empreinte carbone des encours sous gestion ?

- MSCI ESG Research
- CDP
- Sustainalytics / Morningstar
- Bloomberg
- Ethifinance
- Moody's (Vigeo)
- FTSE Russel (Beyond Rating)
- ISS
- S&P (Trucost)
- Carbone 4
- Autre
- Aucun

Q4.20 **Si autre** : Merci de préciser les fournisseurs de données principaux que vous utilisez qui ne sont pas présents dans la liste précédente :

Fournisseur empreinte carbone autre 1

Fournisseur empreinte carbone autre 2

Q4.21 Quels fournisseurs de données externes utilisez-vous pour la biodiversité ?

- MSCI ESG Research
- Sustainalytics / Morningstar
- Moody's (Vigeo)
- CDP forests
- CDC biodiversité
- Carbone 4
- Taskforce on Nature-related Financial Disclosures (TNFD)
- CBF (IceBerg Data Lab anciennement I care and I consult)
- NEC initiative
- Autre
- Aucun

Q4.22 **Si autre** : Merci de préciser les fournisseurs de données principaux que vous utilisez qui ne sont pas présents dans la liste précédente :

Fournisseur biodiversité autre 1

Fournisseur biodiversité autre 2

Q4.23 Quelle agence de conseil en vote utilisez-vous ?

Quelle agence de conseil en vote utilisez-vous ?

- Proxinvest
- ISS
- Broadridge
- Autre
- Aucun

Q4.24 **Si autre** : Merci de préciser les fournisseurs de données principaux que vous utilisez qui ne sont pas présents dans la liste précédente :

Q4.25 Que représente, en pourcentage, le coût de l'ensemble des achats de données ESG-Climat par rapport aux données financières totales ?

Reporting

Q4.26 Publiez-vous un reporting lié à l'Article 29-LEC ? Oui/non

Q4.27 **Si oui** : Merci de copier-coller le lien vers votre article 29.

Q4.28 **Si non** : Merci de copier-coller le lien vers votre rapport d'investissement responsable.

Explications pour remplir le tableau :

Nous considérons que certaines sociétés de gestion **peuvent avoir des politiques d'exclusion différentes en fonction du périmètre**. Il est possible de renseigner au maximum **3 seuils d'exclusion pour 3 périmètres de fonds**. Si vous disposez d'un seul seuil d'exclusion pour tous vos fonds, merci de remplir uniquement les colonnes destinées au seuil n°1 et d'indiquer 100% pour la colonne périmètre de couverture.

Le seuil n°1 est considéré comme celui le plus général (couvrant le plus d'actifs), les seuils 2 et 3 sont ceux applicables sur un périmètre plus restreint.

Exemple ci-dessous :

La politique d'exclusion sur le tabac : pour les fonds labélisés ISR le seuil d'exclusion est de 0% et cela couvre 10% des fonds ouverts. Le reste des fonds ouverts (90%) ont un seuil d'exclusion de 10%.

La politique d'exclusion des jeux d'argent couvre 30% des fonds ouverts représentant uniquement les fonds SFDR 8 et 9 pour un seuil d'exclusion de 5% du CA.

Pas de politique d'exclusion sur la pornographie ni sur les armes controversées.

	Exclusion sectorielle Case à cocher si le secteur est soumis à une politique d'exclusion	Le ou les seuils d'exclusion en % du chiffre d'affaires			Types de fonds sur lesquels ce seuil s'applique (i.e. SFDR 8,9, Impact, Labélisés ISR etc.)			Périmètre de couverture : % fonds ouverts / total fonds ouverts		
		Seuil n°1	Seuil n°2	Seuil n°3	Seuil n°1	Seuil n°2	Seuil n°3	Seuil n°1	Seuil n°2	Seuil n°3
Tabac	<input checked="" type="checkbox"/>	0	10		Fonds ISR	Autre		10	90	
Armes controversées	<input type="checkbox"/>									
Jeux d'argent	<input checked="" type="checkbox"/>	5			SFDR 8, 9			30		
Pornographie	<input type="checkbox"/>									

Q5.9 Si armes controversées : Quelles armes incluez-vous dans votre politique d'exclusion armes controversées ?

- Mines anti-personnel
- Armes à sous-munitions
- Armes chimiques
- Armes biologiques
- Armes à fragment non détectables
- Armes à laser aveuglant
- Armes incendiaires
- Armes au phosphore blanc
- Armes à uranium appauvri
- Armes nucléaires
- Autre
- Aucune

Q5.10 Si tabac : Pour les sociétés de gestion ayant ce niveau de granularité, merci de préciser le seuil d'exclusion appliqué pour chacun des acteurs ci-dessous intervenants dans la chaîne de valeur du tabac (% de chiffre d'affaires). Pour les sociétés de gestion n'ayant pas ce niveau de granularité, merci de renseigner « NA ».

Producteurs	<input type="text"/>
Fournisseur	<input type="text"/>
Détaillants	<input type="text"/>
Les produits à fumer alternatifs	<input type="text"/>
Grossistes	<input type="text"/>

Labels, taxonomie, SFDR 8 et 9

Q5.11 Merci de répondre au tableau ci-dessous. Les % (en nb de fonds ouverts et en encours fonds ouverts) sont calculés uniquement pour l'offre commercialisée en Europe (EEE + Suisse + UK).

	Labels obtenus sur un ou plusieurs fonds ouverts	Représentativité du label dans les fonds ouverts totaux européens.	Représentativité du label dans les encours des fonds ouverts au niveau européen.
	Cocher si vous avez un des labels ci-dessous	% nombre de fonds (ouverts)	% des encours totaux des fonds ouverts
Label ISR	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
FNG-Siegel	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
LuxFlag ESG	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Toward Sustainability	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Umweltzeichen	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Nordic Swan Ecolabel	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
LuxFlag Environnement	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
LuxFlag Climate Finance	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Label Greenfin	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Label Reliance	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Label Finansol	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Q5.12 Taxonomie européenne, merci de répondre au tableau ci-dessous pour l'ensemble des fonds ouverts :

	% d'activités éligibles		% activités alignées		% activités transitoires		% activités habilitantes	
	% Chiffre d'affaires	% Capex	% Chiffre d'affaires	% Capex	% Chiffre d'affaires	% Capex	% Chiffre d'affaires	% Capex
Objectif 1 : Atténuation du changement climatique	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Objectif 2 : Adaptation au changement climatique	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Q5.13 Les données relatives à la taxonomie européenne sont : uniquement estimées / reportées directement par les entreprises investies / les deux.

Q5.14 Si estimation : Merci de donner le nom du fournisseur utilisé pour les données relatives à la taxonomie européenne.

Q5.15 Part des encours totaux (en %) dans les entreprises actives dans les énergies fossiles (toute entité tirant un revenu même non significatif de ce secteur) sur tous les fonds ouverts au **31 décembre 2022** (PAI 4 SFDR).

Q5.16 Part des encours totaux (en %) dans les entreprises actives dans les énergies fossiles au **31/12/2022**. On prendra ici pour chaque entreprise le % de ses activités économiques (CA) liées aux énergies fossiles pondéré par son poids dans les encours totaux de la société de gestion.

Q5.17 Nom du fournisseur de données permettant de calculer votre exposition aux énergies fossiles (cf : les deux questions précédentes).

Q5.18 Merci de renseigner les champs ci-dessous sur l'offre commercialisée en Europe uniquement (EEE + Suisse + UK)

	Représentativité des fonds SFDR	
	% nombre de fonds (ouverts)	% des encours totaux des fonds ouverts
Fonds SFDR 8 en 2021	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Fonds SFDR 8 en 2022	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Fonds SFDR 9 en 2021	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Fonds SFDR 9 en 2022	<input type="text"/>	<input type="text"/>

II.2) Les politiques climatiques

Émissions carbonées

Q6.2 Votre société de gestion a-t-elle des objectifs de réduction d'émissions de GES de ses investissements afin d'être net zéro en 2050 (réduction maximisée puis compensation possible sur le résiduel) ? Oui/non

Q6.3 **Si oui** : Quels sont vos objectifs de réduction d'émission de GES fixés au 31 décembre 2022 pour les horizons suivants : Court terme (2025), Moyen terme (2030 – 2035), Long terme (2040)

Q6.4 **Si oui Q6.2** : Sur quel périmètre les objectifs de réduction d'émissions de GES sont valables ? **Merci de répondre en % du nombre de fonds ouverts.**

Q6.5 Révisiez-vous régulièrement vos objectifs de réductions d'émissions de GES ? Oui/non/JNP

Q6.6 **Si oui** : Merci d'indiquer la fréquence de révision de vos objectifs.

Q6.7 Merci de copier-coller le lien vers votre politique publique vis-à-vis de vos objectifs de réduction d'émissions de GES.

Q6.8 Quelle méthode utilisez-vous pour calculer votre **empreinte carbone** ?

Rappel : L'empreinte carbone se calcule comme suit ci-dessous. **Cependant, Xi peut prendre 3 valeurs différentes : capitalisation boursière de i (CB) / la valeur de l'entreprise i (VE) / la valeur de l'entreprise i incluant les liquidités (EVIC).** Merci de préciser la méthode retenue pour le calcul de votre empreinte carbone.

$$\text{Empreinte carbone} = \sum_i \frac{I_i}{X_i} * E_i$$

I_i : valeur de l'investissement
 E_i : Emissions annuelles de i

- Utilisation de la capitalisation boursière
- Utilisation de la valeur de l'entreprise
- Utilisation de la valeur de l'entreprise incluant les liquidités
- Autre

Q6.9 **Si autre** : Merci de préciser la méthode retenue pour calculer l'empreinte carbone.

Q6.10 Quelles étaient les empreintes carbone totales de vos investissements en fonds ouverts en 2019 et 2022 ?

	Empreinte carbone (en tonnes de CO2)	
	2019	2022
Scopes 1 et 2	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Scope 3	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Q6.11 Le calcul de l'empreinte carbone de vos investissements est réalisé sur :

- Toutes les classes d'actifs en portefeuille
- Actions
- Obligations d'entreprises
- Obligations souveraines
- Monétaire / trésorerie
- Infrastructure
- Immobilier
- Hedge funds
- Entreprises non cotées
- Autre
- Je ne sais pas

Q6.12 Quelles étaient les **émissions financées** par vos investissements en fonds ouverts en 2019 et 2022 (Empreinte carbone par M€ investi) ?

Rappel méthodologique du calcul des émissions financées : [Empreinte carbone / Valeur du portefeuille (somme des valeurs de marché des positions détenues)] x 1 000 000

	Emissions financées (en tonne de Co2 par M€ investi)	
	2019	2022
Scopes 1 et 2	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Scope 3	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Q6.13 Quelle était l'intensité carbone de vos investissements en fonds ouverts (empreinte carbone en tonnes de CO2 par M€ de chiffre d'affaires) ?

Rappel du calcul de l'intensité carbone d'un portefeuille :

$$\text{Intensité carbone} = \frac{\text{Empreinte carbone}}{\sum_i \frac{I_i}{CB_i} * CA_i} * 1\,000\,000$$

I_i : valeur de l'investissement i
 CB_i : capitalisation boursière de i
 CA_i : chiffre d'affaires de i

	Intensité carbone (en tonne de Co2 par M€ de CA)	
	2019	2022
Scopes 1 et 2	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Scope 3	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Q6.14 Sur les politiques d'investissement concernant le secteur énergétique fossile, menez-vous : **[Si aucune politique n'est mise en place fin de la sous-partie].**

- Uniquement une politique d'exclusion partielle ou totale
- Uniquement une politique d'engagement actionnarial (aucune exclusion)
- Une politique d'exclusion et une politique d'engagement
- Aucune politique

Politique d'investissement du charbon

Q6.15 Avez-vous une politique de désinvestissement (engagement et/ou exclusion) au niveau du charbon ? Oui/non **[Si non passage à la question Q6.27]**

Q6.16 : **Si oui** : suivez-vous les recommandations du guide AFG dans votre stratégie de sortie du charbon ? oui/ non

Q6.17 **Si l'exclusion est un instrument utilisé (Q6.14)** : Merci de renseigner le tableau ci-dessous traitant des **politiques d'exclusions du charbon au 31 décembre 2022**.

Nous considérons que certaines sociétés de gestion peuvent avoir des politiques d'exclusion différentes en fonction du périmètre. Il est possible de **renseigner au maximum 3 seuils d'exclusion** pour 3 périmètres de fonds. Si vous disposez **d'un seul seuil d'exclusion pour tous vos fonds**, merci de remplir uniquement les colonnes destinées au seuil n°1 et **d'indiquer 100% pour la colonne périmètre de couverture**.

Le seuil n°1 est considéré comme celui le plus général (couvrant le plus d'actifs), les seuils 2 et 3 sont ceux applicables sur un périmètre plus restreint.

	Exclusion sectorielle	Le ou les seuils d'exclusion (en référence à la première colonne)			Types de fonds sur lesquels ce seuil s'applique (i.e. SFDR 8,9, Impact, Labelisés ISR etc.)			Périmètre de couverture : % fonds ouverts / total fonds ouverts			
		Case à cocher si le secteur est soumis à une politique d'exclusion	Seuil n°1	Seuil n°2	Seuil n°3	Seuil n°1	Seuil n°2	Seuil n°3	Seuil n°1	Seuil n°2	Seuil n°3
% du chiffre d'affaires	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
% de la production	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
capacité installée (MW)	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
millions de tonnes de production	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Aucun investissement dans les entreprises listées par la Urgewald List (Global Exit Coal List)	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Q6.18 Si l'exclusion est un instrument utilisé (Q6.14) : Comptez-vous revoir à la baisse ces seuils d'ici 2025 ? Oui/Non/Je ne sais pas

Q6.19 Si l'exclusion est un instrument utilisé (Q6.14) : Ces exclusions portent-elles sur : les projets financés / Les entreprises qui réalisent ces projets (ne respectant pas votre politique d'exclusion) / Les deux.

Q6.20 Concernant les entreprises qui développent de nouvelles mines à charbon, quelle est votre politique ? Un engagement actionnarial est débuté, Exclusion totale, Aucune politique n'est mise en place, Autre, Je ne sais pas

Q6.21 Concernant les entreprises qui développent de nouvelles infrastructures dédiées au charbon, quelle est votre politique ? Un engagement actionnarial est débuté, Exclusion totale, Exclusion partielle (entre 1% du CA et 20% du CA), Aucune politique n'est mise en place, Autre, Je ne sais pas

Q6.22 Concernant les entreprises qui développent de nouvelles centrales électriques au charbon, quelle est votre politique ?

- Exclusion totale
- Exclusion pour toutes celles où la capacité déployée est au dessus de 100 MW
- Exclusion pour toutes celles où la capacité déployée est au dessus de 300 MW
- Exclusion pour toutes celles où la capacité déployée est au dessus de 500 MW
- Aucune politique n'est mise en place
- Autre
- Je ne sais pas

Q6.23 Avez-vous mis en place une date publique de sortie définitive du charbon ? Oui/non

Q6.24 Si oui : Quelle est la date de sortie ? 2030 toutes zones géographiques/ 2040 pour toutes zones géographiques/ 2030 pour les pays de l'OCDE et 2040 pour le reste du monde / La date n'est pas encore fixée / Je ne sais pas

Q6.25 Si oui à 6.23, sur quel périmètre s'applique cette date de sortie du charbon (% du nombre de fonds ouverts) ?

Q6.26 Merci de copier-coller le lien vers votre politique sur le charbon.

Politique de désinvestissement des hydrocarbures conventionnels et non conventionnels

Q6.27 Disposez-vous d'une politique de désinvestissement (engagement et/ou exclusion) des hydrocarbures non conventionnels ? Oui/non/Je ne sais pas [**Si non, passage à la question Q6.41**]

Q6.28 Si oui : suivez-vous les recommandations du guide AFG dans votre stratégie de sortie des énergies fossiles non conventionnelles ?

Q6.29 Merci de cocher, parmi les éléments suivants, ce que votre société de gestion inclut dans sa politique vis-à-vis des hydrocarbures non conventionnels.

- forage / exploitation dans la région Arctique
- gaz de couche / gaz de houille
- gaz et pétrole de schiste
- hydrates de méthane
- pétrole et gaz de réservoir compact
- pétrole et gaz offshore
- pétrole extra-lourd
- sable bitumeux
- autre
- je ne sais pas

Q6.30 **Si Arctique est cochée** : Merci de préciser sur quel périmètre de la zone Arctique votre politique s'applique :

- Océan Arctique
- Mer Norvégienne
- Mer du Nord
- Mer de Barents
- Mer de Kara
- Zone définies par l'AMAP : Arctic Monitoring and Assessment Program
- Aucune définition précise a été réalisée
- Autre

Q6.31 **Si autre** : Merci de préciser le périmètre défini.

Q6.32 Quelle est votre politique à l'égard des entreprises qui développent de nouvelles activités d'exploration et de forage d'hydrocarbures non conventionnels ?

- Un engagement actionnarial est débuté
- Exclusion totale
- Aucune politique n'est mise en place
- Autre
- Je ne sais pas

Q6.33 Si l'exclusion est un instrument utilisé (Q6.14) : Merci de préciser les seuils d'exclusion au niveau de votre société de gestion pour les critères retenus au **31 décembre 2022**.

Nous considérons que certaines sociétés de gestion peuvent avoir des politiques d'exclusion différentes en fonction du périmètre. Il est possible de **renseigner au maximum 3 seuils d'exclusion** pour 3 périmètres de fonds. Si vous disposez **d'un seul seuil d'exclusion pour tous vos fonds**, merci de remplir uniquement les colonnes destinées au seuil n°1 et **d'indiquer 100% pour la colonne périmètre de couverture**.

Le seuil n°1 est considéré comme celui le plus général (couvrant le plus d'actifs), les seuils 2 et 3 sont ceux applicables sur un périmètre plus restreint.

	Exclusion sectorielle Case à cocher si le secteur est soumis à une politique d'exclusion	Le ou les seuils d'exclusion (en référence à la première colonne)			Types de fonds sur lesquels ce seuil s'applique (i.e. SFDR 8,9, Impact, Labelisés ISR etc.)			Périmètre de couverture : % fonds ouverts / total fonds ouverts		
		Seuil n°1	Seuil n°2	Seuil n°3	Seuil n°1	Seuil n°2	Seuil n°3	Seuil n°1	Seuil n°2	Seuil n°3
% de la production totale d'hydrocarbures non conventionnels	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
% de la part d'hydrocarbures non conventionnels dans le chiffre d'affaires	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Autre	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Q6.34 Si l'exclusion est un instrument utilisé (Q6.14) : Comptez-vous revoir à la baisse ces seuils d'ici 2025 ? Oui/Non/Je ne sais pas

Q6.35 Si l'exclusion est un instrument utilisé (Q6.14) : Ces exclusions portent-elles sur : les projets financés / les entreprises qui réalisent ces projets / autre (plusieurs réponses possibles)

Q6.36 Avez-vous une date de sortie des hydrocarbures non-conventionnels ? Oui/non/Je ne sais pas

Q6.37 Si oui : Merci de préciser la date de sortie (uniquement l'année).

Q6.38 Si oui à Q36, Sur quel périmètre s'applique la politique de sortie des hydrocarbures non-conventionnels ? (% en nombre de fonds ouverts)

Q6.39 Votre politique concernant l'investissement dans les hydrocarbures non-conventionnels est-elle publique ? Oui/non/Je ne sais pas

Q6.40 Merci de copier-coller le lien vers la politique des hydrocarbures non conventionnels :

Q6.41 Avez-vous une politique de désinvestissement (engagement et/ou exclusion) concernant les hydrocarbures conventionnels ? Oui/non/Je ne sais pas **[Si non : fin de la sous-partie]**

Q6.42 Continuez-vous de financer le développement de nouveaux projets gaziers et pétroliers conventionnels ? Oui, Oui mais arrêt définitif d'ici quelques années, Non, Je ne sais pas

Q6.43 Si oui mais arrêt définitif d'ici quelques années : Merci de préciser l'année d'arrêt de financement de nouveaux projets d'hydrocarbures conventionnels :

Q6.44 **Si non Q6.42** : Depuis quelle année avez-vous arrêté de financer les nouveaux projets d'hydrocarbures conventionnels ?

Q6.45 A quel périmètre s'applique la politique vis-à-vis des hydrocarbures conventionnels ?

- 100 % des fonds ouverts
- Les fonds SFDR 8
- Les fonds SFDR 9
- Les fonds labélisés ISR
- Autre
- Je ne sais pas

Q6.46 **Si autre** : Merci de préciser sur quel périmètre cette politique des hydrocarbures conventionnels s'applique (en % du nombre de fonds ouverts) :

Q6.47 Cette politique sur les hydrocarbures conventionnels est-elle publique ? Oui/non/Je ne sais

Q6.48 **Si oui** : Merci de copier-coller le lien vers la politique d'investissement dans les hydrocarbures conventionnels :

II.3) Alignement aux objectifs climatiques

Q7.2 Avez-vous mis en place un scénario d'alignement (calcul d'une trajectoire de température) ?
[Si réponse 1 & 2 alors passage à Q8.2]

- La société de gestion ne compte pas utiliser de calcul de la trajectoire de la température de ses investissements
- La société de gestion ne l'a pas encore mis en place mais envisage de le faire d'ici fin 2023
- La société de gestion l'a mis en place et fait appel à un prestataire externe pour calculer la trajectoire de température de ses investissements
- La société de gestion l'a mis en place et construit sa propre méthodologie de calcul de la trajectoire de température de ses investissements

Q7.3 A quel périmètre s'applique le calcul de l'alignement (en % du nombre de fonds ouverts total) ?

Q7.4 Sur quelle(s) classe(s) d'actifs êtes-vous en mesure de calculer l'alignement ?

- Toutes les classes d'actifs
- Actions
- Obligations d'entreprises
- Obligations souveraines
- Monétaire / trésorerie
- Infrastructure
- Immobilier
- Hedge funds
- Entreprises non cotées
- Autre
- Je ne sais pas

Q7.5 A quelle trajectoire votre scénario d'alignement fait référence ? 3°, 2, 1,5°, autre

Q7.6 Le scénario d'alignement utilisé prend en compte : scopes 1 et 2 etc...

Q7.7 Quelle est la métrique utilisée par votre scénario d'alignement ?

Binary target measurement metrics
Benchmark divergence metrics
Implied Temperature Rise (ITR) metrics
Maturity scale alignment metrics

Note :

Mesure binaire des objectifs / Binary target measurement metrics : la mesure d'objectifs binaires fournit des informations sur le pourcentage de sociétés du portefeuille ayant des objectifs de réduction d'émissions à 1,5 degré C validés scientifiquement.

Echelle de maturité / Maturity scale alignment metrics : regroupent les entreprises du portefeuille dans des catégories d'alignement, par exemple, alignées, en cours d'alignement et non alignées sur une trajectoire de 1,5 degré C.

Divergence aux indices de référence / Benchmark divergence metrics : vise à évaluer la distance par rapport à une trajectoire alignée sur un objectif de zéro émission nette. Elle peut fournir une vision absolue du dépassement ou de l'insuffisance du budget carbone si elle est mesurée sur la base des émissions cumulées.

Hausse implicite de la température / Implied temperature rise (ITR) : traduit la distance par rapport à une trajectoire mesurée dans un modèle de divergence de référence en une projection probable du réchauffement climatique à la fin du siècle.

Q7.8 **Si utilisation d'un prestataire externe Q7.2** : Merci de définir le ou les fournisseurs de données utilisés pour mesurer l'alignement des différentes classes d'actifs.

- Carbone 4 finance
- CDP-WWF Temperature rating
- EcoAct
- EMMI (The European Money Market Institute)
- ESG BOOK
- I care and I consult
- ISS ESG
- Moody's ESG Solutions
- MSCI
- OS-Climate
- Pacta / RMI
- Right Based on science
- TPI (Transition Pathway Initiative)
- S&P Global Sustainable1
- Autre
- Je ne sais pas

Q7.9 **Si autre** : Merci de renseigner le nom du fournisseur de scénario d'alignement utilisé.

Q7.10 Pour quelle(s) raison(s) utilisez-vous un scénario d'alignement ?

- Pour fixer des objectifs de décarbonation
- Mettre en place une stratégie d'investissement pour décarboner le portefeuille
- Outils de suivi : permet de savoir si les objectifs passés ont été atteints ou non
- Recommandé par la réglementation et les régulateurs de marché
- Confirmer que mon portefeuille est déjà aligné à un scénario 2°C
- Identifier les risques de transition et physique impliqués par le changement climatique
- Mener à bien la recherche et sélection des investissements
- Quantifier l'impact positif des investissements dans les secteurs bas-carbone
- Autre
- Je ne sais pas

Q7.11 Votre politique et les résultats de(s) scénario(s) d'alignement sont-ils publics ? Oui, non, je ne sais pas

Q7.12 **Si oui** : Merci de copier-coller le lien vers la politique d'alignement de la société de gestion :

II.4) Analyses des risques climatiques, environnementaux et liés à la biodiversité.

Prise en compte des risques extra-financiers

Q8.2 Identifiez-vous l'exposition aux risques physiques et de transition liée aux changements climatiques, environnementaux et de biodiversité ? Oui, non, je ne sais pas [**Si non ou je ne sais pas, passage à la question Q8.13**]

Q8.3 Quel service au sein de votre société de gestion s'occupe de gérer l'ensemble de ces risques extra-financiers ?

L'équipe ISR/ESG, Les équipes d'investissement, Les équipes de risque, Autre, Je ne sais pas, Aucun

Q8.4 **Si autre** : Merci de préciser quel service s'occupe du suivi des risques extra-financiers ?

Q8.5 Utilisez-vous des fournisseurs de données externes afin de calculer votre exposition aux risques physiques ? Oui, non, je ne sais pas

Q8.6 **Si oui** : Merci de sélectionner les fournisseurs utilisés pour l'analyse des risques physiques.

- Beyond Ratings (LSEG) - CLAIM
- CDP Climetrics
- Carbone 4 - CRIS
- I care and I consult
- Bloomberg ESFG Data
- Acclimatise
- Oliver Wyman, Mercer
- Sustainalytics ESG Ratings
- Oekom Climate Risk Portfolio Check
- EcoAct ClimFIT
- MSCI Climate Change Metrics
- Vigeo Eiris
- S&P Trucost
- Carbon delta
- 2DII Pacta
- Autre
- Je ne sais pas

Q8.7 **Si oui Q8.5** : Utilisez-vous des fournisseurs de données externes afin de calculer votre exposition aux risques de transition ? Oui, non, je ne sais pas

Q8.8 **Si oui** : Merci de sélectionner les fournisseurs utilisés pour l'analyse des risques de transition. Même liste que pour les risques physiques.

Q8.9 Sur quel périmètre les risques liés au changement climatique sont-ils calculés (en % du nombre de fonds ouverts total) ?

Q8.10 Avez-vous calculé une estimation quantitative de l'impact financier des principaux risques en matière environnementale, sociale et climatique ? Oui, non, je ne sais pas

Q8.11 Les résultats des méthodes utilisées sont-ils rendus publics par votre société de gestion ? Oui, non, je ne sais pas

Q8.12 **Si oui** : Merci de copier-coller le lien vers votre politique d'analyse et de gestion des risques ESG

Mesure impact sur la biodiversité

Q8.13 Suivez-vous l'impact de vos investissements sur la biodiversité ? Oui, non, je ne sais pas

Q8.14 **Si oui** : Merci de lister les indicateurs principaux utilisés pour la biodiversité (maximum 3) :

	Nom de la méthode	Fournisseurs des méthodes utilisées	Description
	Liste des méthodes retenues	Liste des fournisseurs	Utilité principale de l'indicateur
Indicateur 1	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Indicateur 2	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Indicateur 3	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Q8.15 Avez-vous une politique d'investissement concernant la déforestation ? Oui, non, je ne sais pas

Q8.16 **Si oui** : Cette politique inclut-elle une exclusion des entreprises impliquées dans les déforestations massives ? Oui, non, je ne sais pas

Q8.17 **Si oui Q8.15** : Merci de copier-coller le lien vers votre politique de déforestation.

II.5) Politique de vote et d'engagement

Q9.2 Mettez-vous en place une politique d'engagement actionnarial ? Oui, non, je ne sais pas [**Si non ou je ne sais pas, passage à la question Q9.13**]

Q9.3 Vous menez l'engagement actionnarial : seul, en collaboratif, les deux, je ne sais pas

Q9.4 **Si en collaboratif ou les deux** : Via quelles coalitions d'investisseurs menez-vous l'engagement actionnarial ?

- La plateforme d'engagement des Principes pour l'Investissement Responsable (PRI)
- Investor Group on Climate Change (IGCC)
- Ceres
- Climate Action 100+
- Institutional Investors Group on Climate Change (IIGCC)
- Shareholders for Change (SfC)
- Interfaith Center on Corporate Responsibility (ICCR)
- La Non-Disclosure Campaign (NDC) du Carbon Disclosure Project (CDP)
- FAIRR
- Plateforme d'engagement du FIR (Forum Investissement Responsable)
- Investors Alliance for Human Rights
- Phitrust
- Autre
- Je ne sais pas

Q9.5 **Si Engagement « seul » ou « collaboratif »** : Avec combien d'entreprises avez-vous engagé un dialogue actionnarial sur 2022 ?

Q9.6 **Si Engagement « les deux »** : Avec combien d'entreprises avez-vous engagé un dialogue actionnarial en 2022 ?

Seul :

En collaboratif :

Q9.7 Quel est le % d'entreprises avec lesquelles vous avez lancé un process d'engagement sur l'ensemble des entreprises financées ?

Q9.8 Merci de sélectionner les secteurs dans lesquels se situent les entreprises avec lesquelles vous avez débuté un engagement actionnarial :

	Secteurs où une méthodologie SBTi existe
	Cocher si vous avez des engagements dans ces secteurs
Acier	<input type="checkbox"/>
Agroalimentaire	<input type="checkbox"/>
Aluminium	<input type="checkbox"/>
Aviation	<input type="checkbox"/>
Chimie	<input type="checkbox"/>
Ciment	<input type="checkbox"/>
Forêts, terres et agriculture	<input type="checkbox"/>
Immobilier	<input type="checkbox"/>
Nouvelles technologies de la communication et de l'information	<input type="checkbox"/>
Pétrole et gaz	<input type="checkbox"/>
Transport	<input type="checkbox"/>
Utilités et électricité	<input type="checkbox"/>
Vêtements et chaussures	<input type="checkbox"/>
Autre	<input type="checkbox"/>
Je ne sais pas	<input type="checkbox"/>

Q9.9 Une fois le processus d'engagement lancé, tous les combien échangez-vous avec l'entreprise (environ) ?

Tous les 3 mois, Tous les 6 mois, Tous les 9 mois, 1 fois par an, Tous les deux ans, Autre, Je ne sais pas

Q9.10 En cas de non atteinte des objectifs fixés par le processus de l'engagement, au bout de combien de temps arrêtez-vous le dialogue ? 1an, 2 ans, 3 ans, 4 ans, plus de 5 ans, autre, jamais, je ne sais pas

Q9.11 **Si arrêt du dialogue** : Si le dialogue échoue et les objectifs fixés ne sont pas atteints, excluez-vous l'entreprise de votre fond ? Oui, Non, Je ne sais pas

Q9.12 Menez-vous l'engagement :

Avant l'assemblée générale (préparations des résolutions ; Régulièrement toute l'année ; Lorsqu'il y a une controverse grave ; Cela dépend, c'est du cas par cas ; Autre ; Je ne sais pas

Q9.13 Avez-vous une politique de vote ? Oui / Non **[Si non, fin de la sous-partie]**

Q9.14 Votre politique de vote intègre-t-elle des critères extra-financiers ? Oui/ non / je ne sais pas

Q9.15 Le document officiel présentant les caractéristiques de votre politique de vote :

- Inclut des critères précis et explicites internes propres à votre société de gestion menant à un vote contre une résolution.
- Détaille les thématiques sur lesquelles se positionne votre société de gestion mais ne fournit pas de liste de critères précis internes propres à votre entité menant à un vote contre une résolution.
- Reprend uniquement les critères de vote d'un ou plusieurs prestataires externes.
- Autre
- Je ne sais pas

Q9.16 Lors de la saison 2022 à combien d'assemblées générales d'entreprises avez-vous voté ?

Merci de renseigner le ratio suivant : (nombre d'entreprises où vous avez participé à l'AG / nombre totale d'entreprises sur les portefeuilles d'equity) %

Q9.17 Avez-vous une politique concernant la rémunération des dirigeants ? Oui, non, je ne sais pas

Q9.18 **Si oui** : Avez-vous voté lors de la saison 2022 contre des résolutions portant sur des "Say On Pay" ? Oui, non, je ne sais pas

Q9.19 Séparation des pouvoirs : votez-vous contre la réélection d'un PDG ? Oui, Non, ça dépend, cas par cas, Je ne sais pas

Q9.20 Avez-vous une politique de vote sur les critères de féminisation du conseil d'administration ? Oui, Non, ça dépend, cas par cas, Je ne sais pas

Q9.21 **Si oui** : En dessous de quel seuil de représentativité féminine votez-vous contre l'élection d'un administrateur homme ? Aucun, 10%, 20%, 30%, 40%, 50%, je ne sais pas

Q9.22 En cas de manque de transparence sur les données extra-financières et un manque d'ambition concernant la transition bas carbone, votez-vous contre la réélection du président du conseil ?

Oui, absolument, Oui, probablement, Probablement pas, Absolument pas

Q9.23 Avez-vous une politique sur les Say On Climate ? Oui, non, je ne sais pas

Q9.24 **Si oui** : Merci de cocher les raisons qui mènent à un vote contre un Say On Climate selon votre politique de vote :

- Manque de transparence de l'entreprise sur les enjeux climatiques
- Le scope 3 n'est pas pris en compte dans les plans de transition
- Le plan de transition ne s'adresse pas à l'ensemble des pays dans lesquels opère l'entreprise
- Le scénario de référence ne s'appuie pas sur un scénario scientifique
- Le plan de transition manque d'ambition et/ou fait preuve d'incohérence
- Cas par cas en fonction des entreprises
- Autre
- Je ne sais pas

Q9.25 Avez-vous une politique de vote sur les critères d'indépendance du conseil d'administration ? Oui, non, je ne sais pas

Q9.26 Merci de répondre aux informations demandées ci-dessous pour la saison de vote 2022.

	Thématiques des résolutions	Représentativité de ces résolutions	Vote contre	Abstention
	Cocher si vous avez été confronté à une des ces thématiques	Nombre de ces résolutions	%	%
Say On Pay Interne (proposé par le management).	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Say On Pay externe (proposé par les actionnaires).	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Réélection / élection d'un PDG.	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Election d'un administrateur homme en cas de faible représentativité des femmes (en dessous de 40%).	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Election d'un administrateur non indépendant en cas de non indépendance du conseil (en dessous de 50% et 33% pour les entreprises contrôlées).	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Réélection d'un président du conseil dans un contexte faibles ambitions vis-à-vis des enjeux climatiques ou pour manque de transparence extra-financières.	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Say On Climate Interne (proposé par le management).	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Say On Climate externe (proposés par les actionnaires).	<input type="checkbox"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Q9.27 Merci de copier-coller le lien vers le document officiel de la politique de vote de votre société de gestion

Q10.1 Souhaitez-vous évoquer un sujet qui vous semble essentiel et qui est non évoqué dans notre questionnaire ?

Q10.2 Avez-vous des remarques vis à vis de ce questionnaire ?

Le questionnaire est désormais terminé. Merci beaucoup pour le temps que vous avez accordé à cet exercice.