

Reporting Septembre 2024

Valeur Liquidative : 124.86€



Edmond SCHAFF



Michel MENIGOZ

Stratégie d'investissement :

L'OPCVM a pour objectif de surperformer, sur un horizon minimum de cinq ans, l'indice MSCI World dividendes réinvestis. L'objectif sera réalisé en mettant en œuvre une stratégie de sélection de titres axée sur la réduction des différents risques liés au changement climatique et sur la gestion de ces risques par les entreprises.

SRI:



Risque le plus faible

Risque le plus élevé

Date de création : 28/07/2021

Devise : EUR

Nature juridique : FCP de droit français - OPCVM

Durée d'investissement conseillée : 5 ans

Dépositaire : Caceis Bank

Valorisateur : CACEIS FA

Commissaire aux comptes : DELOITTE & ASSOCIES

Actif net du fonds : 189.65 M€

Article SFDR : 8

Indice de référence : MSCI World €

Fréquence de valorisation : Quotidien

Centralisation : 15h en J

Règlement : J+3

Affectation des résultats : Capitalisation

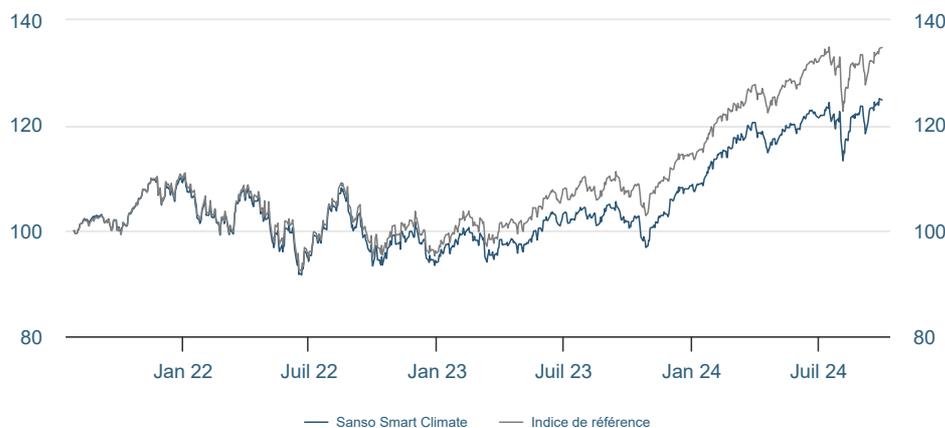
Frais de gestion financière et administratifs : 2%

Commissions de surperformance : 20% TTC de la surperformance annuelle du FCP par rapport à l'indice

Commissions de souscription : 2% max

Commissions de rachat : Néant

Evolution de la performance depuis 5 ans ou création



Performance

	Septembre	2024	1 an	3 ans	5 ans	Depuis création	Annualisée depuis création
Sanso Smart Climate	0.94%	15.03%	22.71%	24.72%		24.86%	7.24%
Indice de référence	1.00%	17.64%	25.63%	34.78%		34.81%	9.85%

Historique des performances mensuelles

Année	Jan.	Fev.	Mars	Avril	Mai	Juin	Juil.	Août	Sept.	Oct.	Nov.	Déc.	Fonds	Benchmark
2024	2.98%	4.30%	3.41%	-3.43%	2.52%	1.99%	0.76%	0.85%	0.94%				15.03%	17.64%
2023	4.79%	-0.49%	0.30%	-0.78%	2.44%	3.30%	1.21%	-0.30%	-2.29%	-3.51%	6.40%	3.92%	15.50%	19.60%
2022	-3.82%	-2.52%	3.39%	-3.43%	-1.80%	-6.08%	11.09%	-3.85%	-7.26%	6.30%	2.52%	-7.60%	-13.88%	-12.78%
2021							-0.49%	3.28%	-2.59%	6.04%	-0.21%	3.01%	9.13%	9.85%

Indicateurs de risque

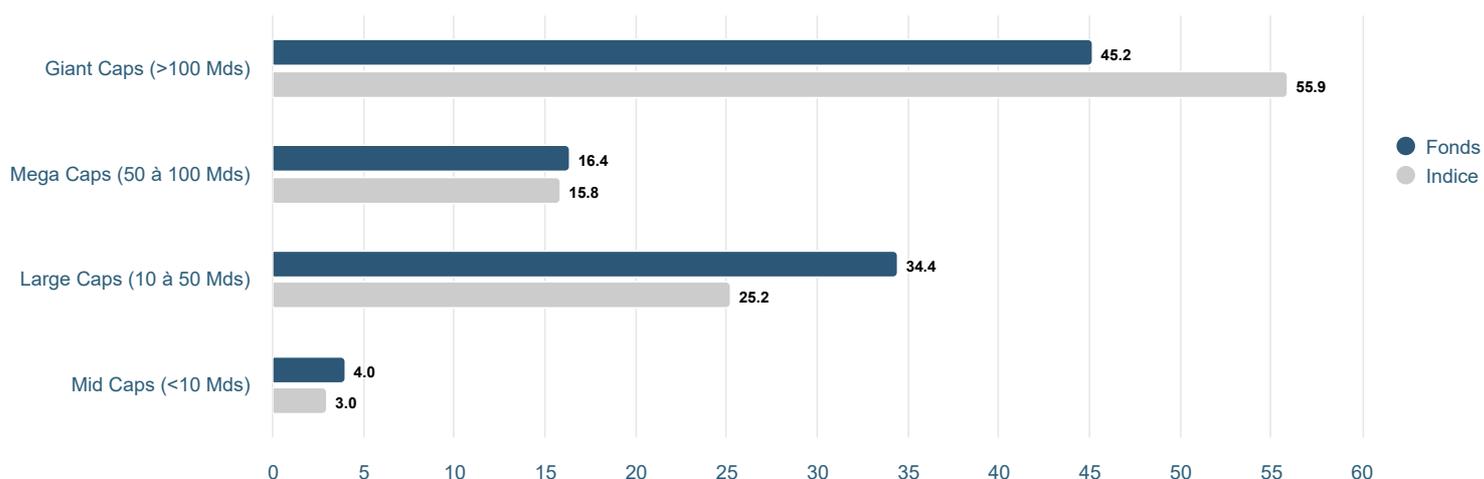
	1 an		Création	
	Fonds	Indice de référence	Fonds	Indice de référence
Sharpe	1.53	1.79	1.38	2.12
Volatilité	12.21%	11.86%	13.60%	13.56%
Drawdown	- 8.89%	- 9.05%	- 16.93%	- 16.85%
Tracking error	2.62%		2.06%	
Beta	1.01		0.99	

Source: Sanso Longchamp AM | Données arrêtées au 30/09/2024

Contact commercial | commercial@sanso-longchamp.com

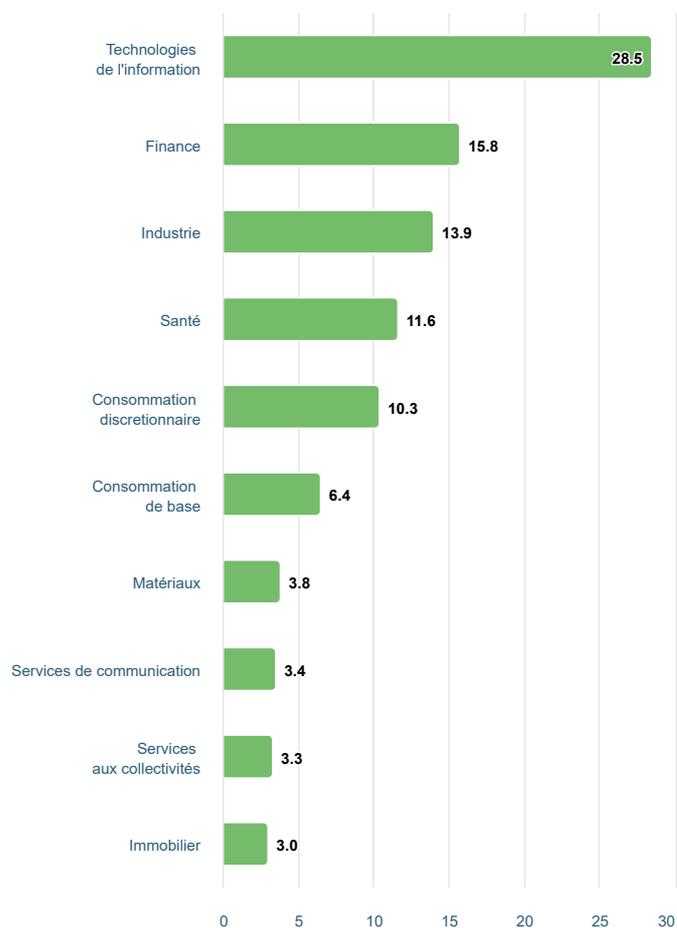
Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures.

Structure du portefeuille

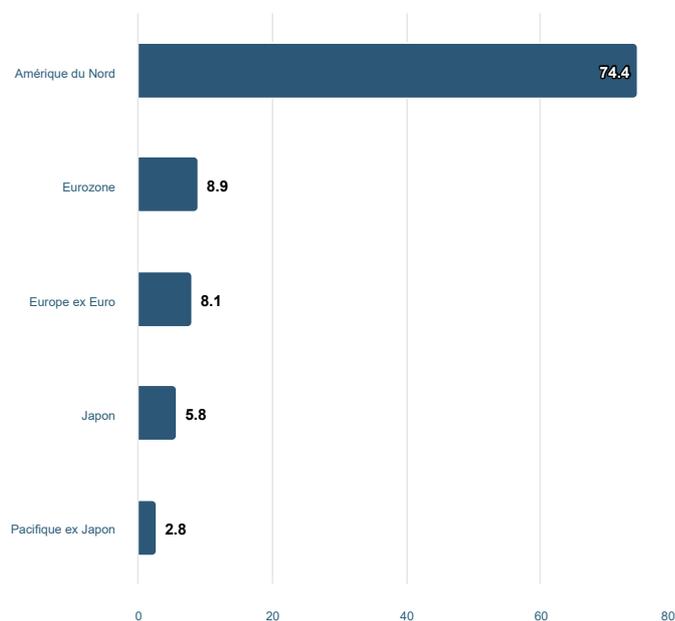


Positionnement du portefeuille

Ventilation par secteur (Poche actions) (%)



Ventilation par région (Poche actions) (%)



Les 5 principales surexpositions

CARRIER GLOBAL CORP	0.8 %
EBAY INC	0.8 %
S&P GLOBAL INC	0.7 %
AMERICAN EXPRESS CO	0.7 %
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	0.7 %
Nombre de lignes :	163

Analyse ESG

Note Moyenne ESG



Taux de couverture



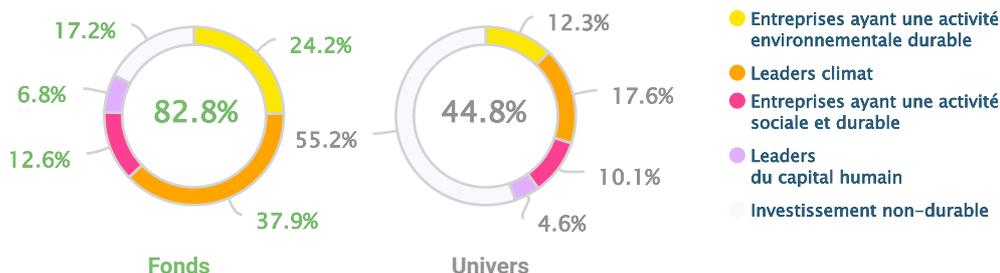
Note moyenne sur chaque pilier ESG



Analyse investissement durable

Décomposition du portefeuille en matière d'investissement durable

% Actif Net



Insuffisance ESG et impact négatif

% Actif Net



Analyse climat

Empreinte carbone

TCO2e/EVIC



Taux de couverture : 97% 97%

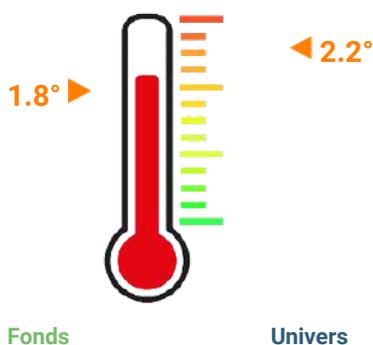
Intensité carbone

TCO2e/\$CA



Taux de couverture : 97% 97%

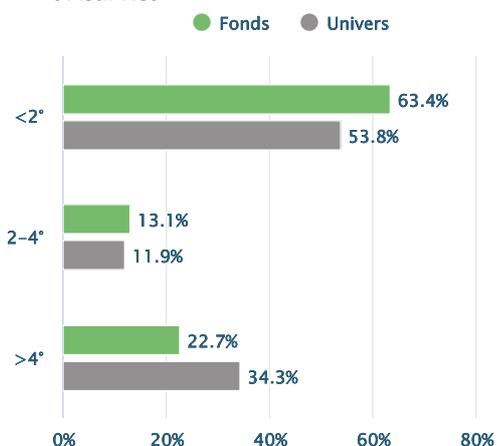
Température du portefeuille



Taux de couverture : 97% 97%

Alignement Scénario Température

% Actif Net



Taux de couverture : 97% 97%

Analyse capital humain

Différence de rémunération entre les femmes et les hommes

-15.1% -15.1%



Fonds Univers

Taux de couverture : 85% 85%

Développement du capital humain

note sur 10



Fonds Univers

Taux de couverture : 93% 89%

Pourcentage de femmes aux conseils d'administration

% actif net



Fonds Univers

Taux de couverture : 93% 89%

Analyse ESG

Notes Moyenne ESG

Note comprise entre 0 et 10 se basant sur l'examen des politiques et pratiques Environnementales Sociales et de Gouvernance (ESG) des entreprises.

Analyse investissement durable

Investissement durable

Titre d'entreprises ayant une contribution environnementale et/ou sociale positive sans avoir d'impact négatif significatif par ailleurs.

Entreprises ayant une activité environnementale durable

Entreprises dont au moins 20% du chiffre d'affaires contribue à la transition énergétique ou à la préservation des ressources naturelles.

Leaders climat

Entreprises identifiées, par Sanso Longchamp AM, comme ayant des actions de pointe en matière de réduction de leurs impacts sur le climat.

Entreprises ayant une activité sociale durable

Entreprises dont au moins 20% du chiffre d'affaires répond aux besoins humains de base ciblés par les Objectifs de Développement Durable ou contribue à l'émancipation des individus.

Leaders capital humain

Entreprises identifiées, par Sanso Longchamp AM, comme ayant une gestion exemplaire de leurs ressources humaines au travers d'avantages sociaux, de programmes de formation etc.

Impact négatif et préjudice important

Titre d'entreprises dont l'activité ou les pratiques contribuent de façon significative à la dégradation de l'environnement ou au réchauffement climatique ou causent un préjudice sensible sur le plan social, par exemple en matière de Droits de l'Homme ou du travail.

Analyse climat

Alignement Scénario Température

Estimation de l'alignement des entreprises sur un scénario de réchauffement climatique sur la base de leurs émissions passées et de leurs objectifs futurs.

Température du portefeuille

Scénario de réchauffement sur lequel se situent le portefeuille et son point de comparaison à horizon 2030.

Empreinte carbone

Rapport entre les émissions de gaz à effet de serre d'une entreprise exprimées en tonnes équivalent CO2 et sa valeur (EVIC – Enterprise Value Including Cash).

Intensité carbone

Rapport entre les émissions de gaz à effet de serre d'une entreprise exprimées en tonnes équivalent CO2 et son chiffre d'affaires en millions de dollars.

Analyse capital humain

Différence de rémunération entre les femmes et les hommes

Différence entre les salaires horaires bruts moyens des hommes et des femmes, exprimée en pourcentage des salaires bruts des hommes.

Développement du capital humain

Note comprise entre 0 et 10 se basant sur la capacité des entreprises à attirer, retenir et développer le capital humain au travers d'avantage sociaux, de programmes de formation etc.

Avertissement/Contact

Les informations contenues dans ce document sont remises uniquement à titre d'information et ne sauraient constituer une information contractuelle ou légale. Ce document a pour but de vous informer de manière simplifiée sur les caractéristiques du fonds et de vous permettre d'apprécier le contexte de marché dans lequel le FCP a été géré. Les performances et réalisations passées ne constituent en rien une garantie pour les performances futures. Le prospectus du fonds est disponible sur le site www.sanso-longchamp.com. ou sur simple demande auprès de SANSO LONGCHAMP AM.

Sanso Longchamp AM - SAS au capital de 563 673 € - N° SIREN 535 108 369 RCS Paris - 17, Rue Chaillot 75116 Paris - www.sanso-longchamp.com.

Société de gestion agréée par l'AMF sous le n° GP-11000033 - N°ORIAS : 12066196.