Reporting Mars 2024
FR0014003NX3 - Part S

Sanso Smart Climate

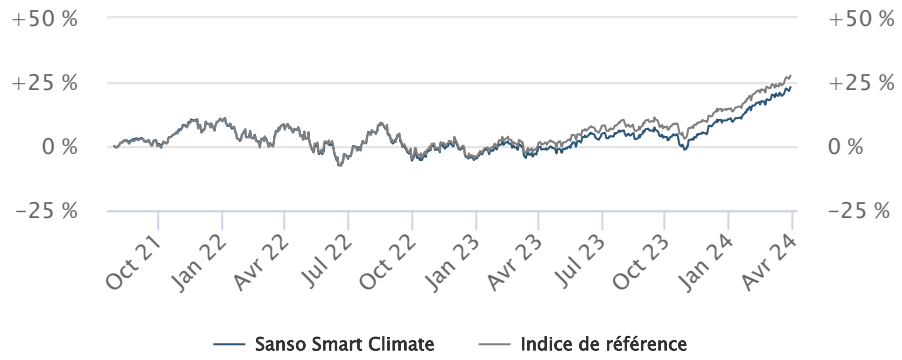
Label ISR

Valeur liquidative : 1 231.02 €

Edmond SCHAFF

Michel MENIGOZ

Evolution de la performance depuis 5 ans ou création



Performances

	Mars	2024	1 an	3 ans	5 ans	Depuis création	Annualisée depuis création
Sanso Smart Climate	3.47%	11.26%	25.58%			23.10%	8.10%
Indice de référence	3.39%	11.33%	27.92%			27.57%	9.56%

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 plus faible — Risque plus élevé

Rendement potentiellement plus faible — Rendement potentiellement plus élevé

Historique des performances mensuelles

Année	Jan.	Fev.	Mars	Avril	Mai	Juin	Juil.	Août	Sept.	Oct	Nov.	Déc.	Fonds	Benchmark
2024	3.03%	4.36%	3.47%										11.26%	11.33%
2023	4.86%	-0.44%	0.36%	-0.74%	2.51%	3.36%	1.27%	-0.23%	-2.24%	-3.45%	6.46%	3.97%	16.32%	19.60%
2022	-3.76%	-2.45%	3.44%	-3.38%	-1.73%	-6.03%	11.11%	-3.75%	-7.21%	6.36%	2.58%	-7.55%	-13.28%	-12.78%
2021							-0.49%	3.39%	-2.47%	6.17%	-0.12%	3.08%	9.69%	9.85%

Date de création : 28/07/2021
Devise : EUR
Nature juridique : FCP de droit francais - OPCVM
Durée d'investissement conseillée : 5 ans
Dépositaire : Caceis Bank
Valorisateur : CACEIS FA
Commissaire aux comptes : DELOITTE & ASSOCIES

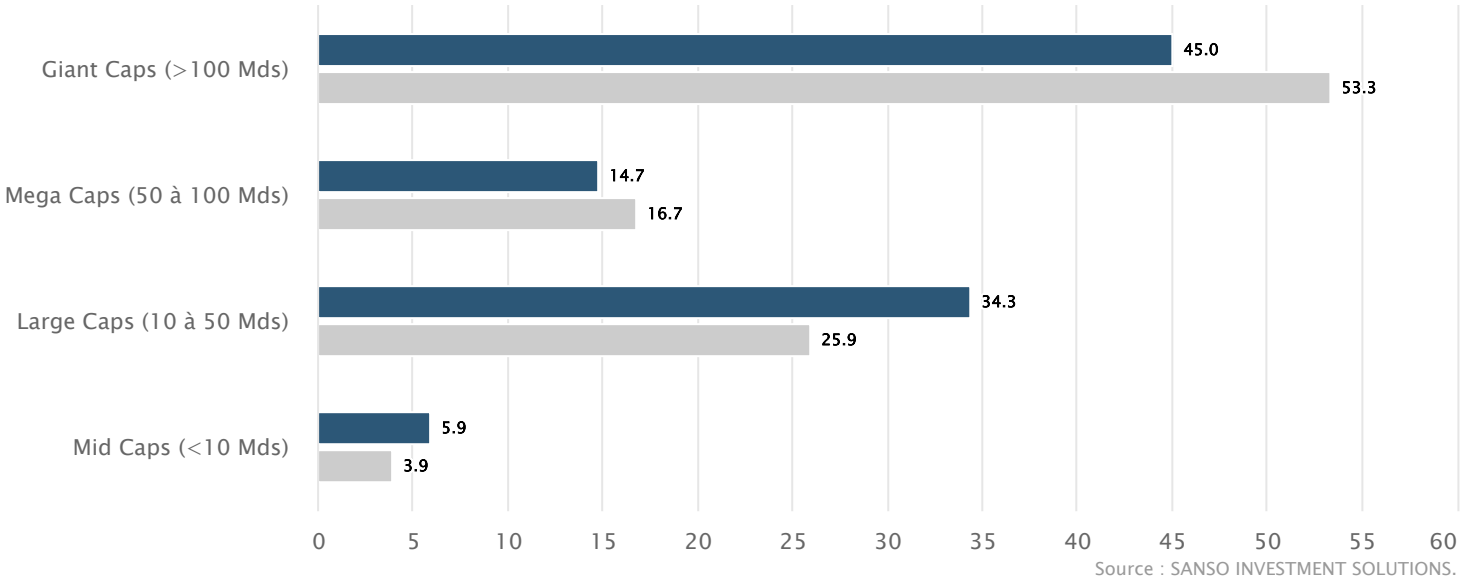
Actif net du fonds : 187.78 M €
Indice de référence : MSCI World €
Fréquence de valorisation : Quotidien
Centralisation : 15h en J
Règlement : J+3
Affectation des résultats : Capitalisation

Frais de gestion financière et administratifs : 1.3 %
Commissions de surperformance : 20% TTC de la superformance annuelle du FCP par rapport à l'indice
Commissions de souscription : 2 % max
Commissions de rachat : Néant

Indicateur de risque

	1 an		Création	
	Fonds	Indice de référence	Fonds	Indice de référence
Sharpe	2.19	2.41	1.39	1.72
Volatilité	9.97%	10.04%	13.70%	13.71%
Drawdown	- 8.18%	- 7.53%	- 16.66%	- 16.85%
Tracking error	2.16%		1.86%	
Beta	0.97		0.99	

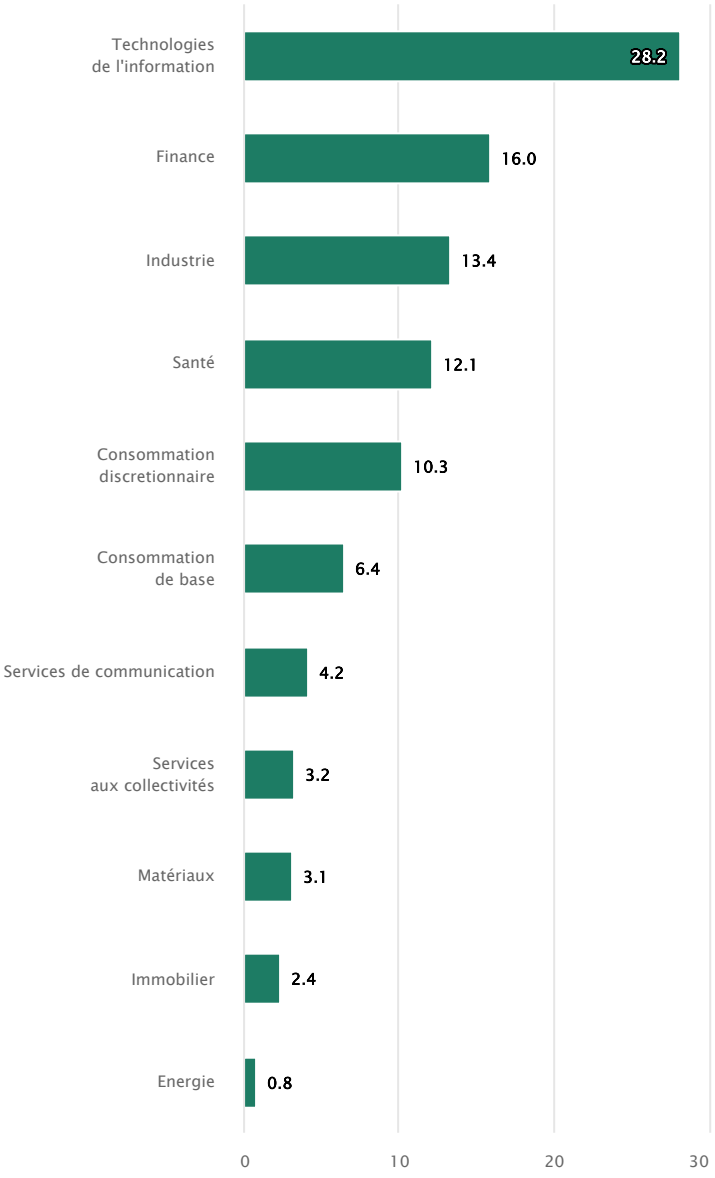
Structure du portefeuille (%)



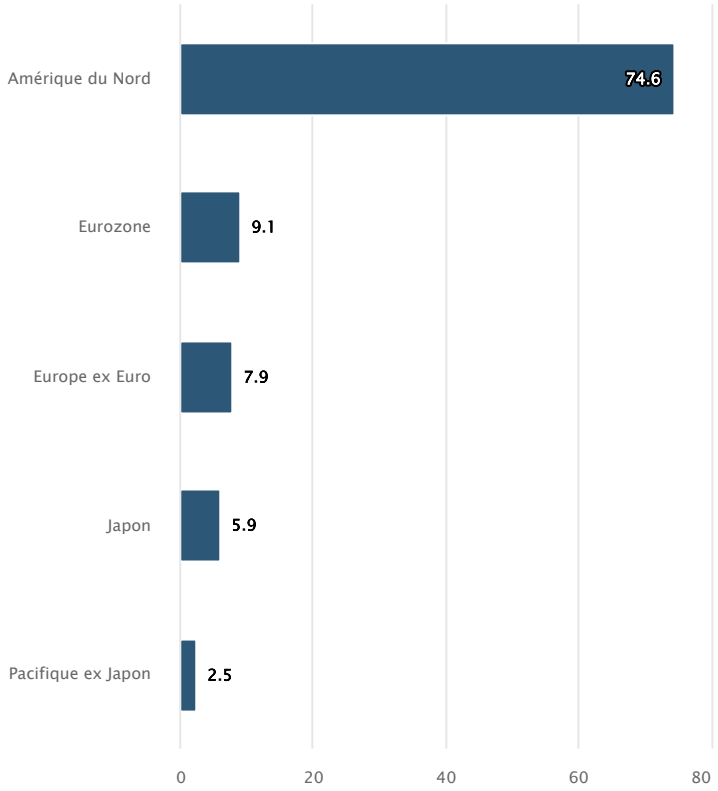
Source : SANSO INVESTMENT SOLUTIONS.

Positionnement du portefeuille

Ventilation par secteur (Poche actions) (%)



Ventilation par région (Poche actions) (%)



Les 5 principales surexpositions

PROGRESSIVE CORP	0.7 %
OWENS CORNING	0.7 %
SCHNEIDER ELECTRIC SE	0.7 %
STEEL DYNAMICS INC	0.7 %
JOHNSON CONTROLS INC	0.7 %
Nombre de lignes :	**167**

Analyse ESG

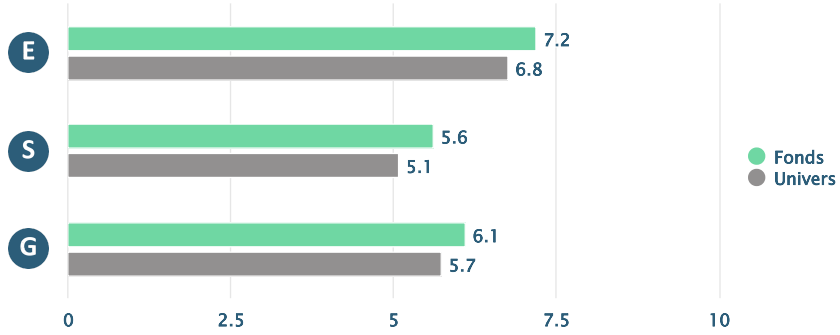
Note Moyenne ESG

Fonds	Univers
8.1/10	6.8/10

Taux de couverture

Fonds	Univers
100%	100%

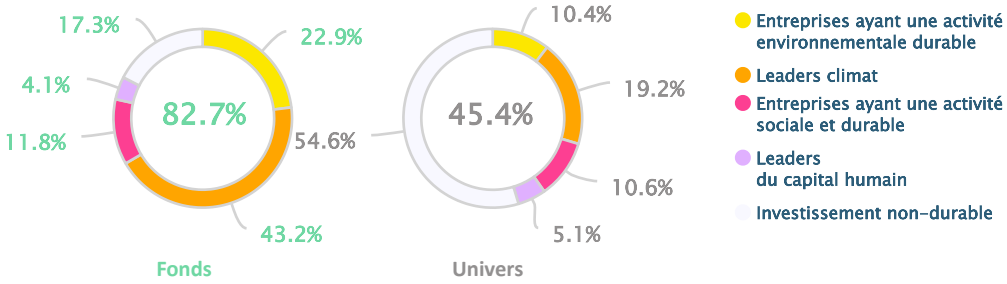
Note moyenne sur chaque pilier ESG



Analyse investissement durable

Décomposition du portefeuille en matière d'investissement durable

% Actif Net



Insuffisance ESG et impact négatif

% Actif Net

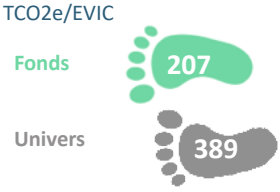
Insuffisance sur les enjeux E, S ou G

Impact négatif

Analyse climat

Empreinte carbone

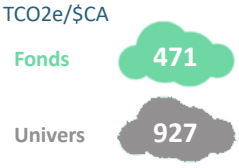
TCO2e/EVIC



Taux de couverture : 98% 97%

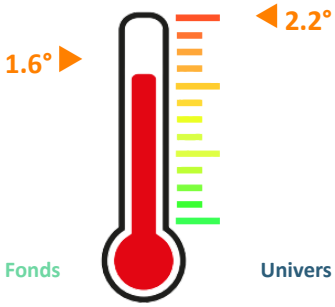
Intensité carbone

TCO2e/$CA



Taux de couverture : 98% 97%

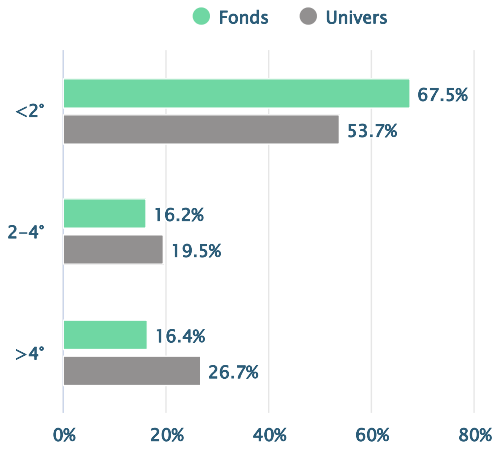
Température du portefeuille



Taux de couverture : 98% 97%

Alignement Scénario Température

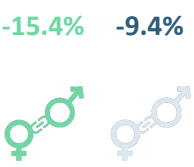
% Actif Net



Taux de couverture : 98% 97%

Analyse capital humain

Différence de rémunération entre les femmes et les hommes



Taux de couverture : 11% 11%

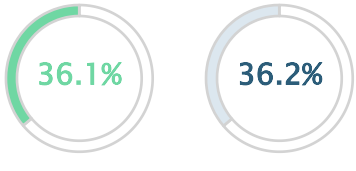
Développement du capital humain

note sur 10

Taux de couverture : 95% 89%

Pourcentage de femmes aux conseils d'administration

% actif net



Taux de couverture : 95% 89%

SANSO IS INVESTMENT SOLUTIONS

Source: SANSO IS, MSCI, S&P Global, Urgewald | Données arrêtées au 31/08/2023

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 IS, 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 IS, 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 – Entreprise 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'avantages 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-is.com ou sur simple demande auprès de SANSO IS.
Sanso Investment Solutions - SAS au capital de 563 673 € - N° SIREN 535 108 369 RCS Paris - 69, Boulevard Malesherbes 75008 Paris - www.sanso-is.com.
Société de gestion agréée par l'AMF sous le n° GP-11000033 - N°ORIAS : 12066196.