BFT AUREUS ISR - P

FR0012903250

MONÉTAIRE 31/10/2026

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : (C) 110,08141 (EUR)
(D) 99,10568 (EUR)

Date de VL et d'actif géré : 30/10/2026

Actif géré : 29 624,95 (millions EUR)

Code ISIN : (C) FR0012903250
(D) FR0012903268

Indice de référence : 100% ESTR CAPITALISE (OIS)

Eligibilité : Compte-titres, Assurance-vie Eligible PEB

Type de VL Monetaire : VL variable

Objectif d'investissement

Réaliser sur la durée de placement recommandée de 1 jour à 1 mois, une performance nette de frais supérieure à l'€str capitalisé, indice représentatif du taux monétaire de la zone euro, tout en intégrant des critères E.S.G (Environnement, Social, Gouvernance) dans le processus de sélection et d'analyse des titres. Pour y parvenir, l'équipe de gestion sélectionne, en euros et en devises, des titres publics ou privés court terme appartenant à la catégorie « Investment Grade » (notation allant de AAA à BBB- sur l'échelle de notation Standards & Poors) et/ou de « bonne qualité » selon le jugement de la société de gestion et dans le respect de la politique interne de suivi du risque de crédit. Le risque de change est couvert.

Indicateur de risque *(Source : Fund Admin)*

1 2 3 4 5 6 7

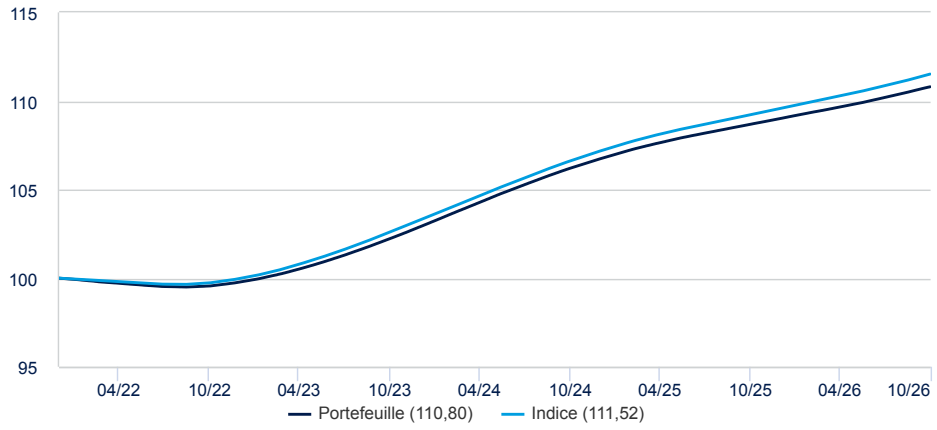
Risque le plus faible — Risque le plus élevé

L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous gardez le produit pendant 1 jour à 1 mois.
L'indicateur synthétique de risque permet d'apprécier le niveau de risque de ce produit par rapport à d'autres. Il indique la probabilité que ce produit enregistre des pertes en cas de mouvements sur les marchés ou d'une impossibilité de notre part de vous payer.

Fonds non garanti en capital

Performances (Source : Fund Admin) - Les performances passées ne préjugent pas des performances futures

EVOLUTION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE EN BASE 100 *(Source : Fund Admin)*



PERFORMANCES NETTES PAR PERIODE GLISSANTE *(Source : Fund Admin)* [1]

Depuis le	Depuis le 31/12/2025	1 mois 30/09/2026	3 mois 31/07/2026	1 an 30/10/2025	3 ans 30/10/2023	5 ans 28/10/2021	Depuis le 13/10/2020
Portefeuille	1,95%	2,16%	2,15%	1,95%	2,72%	2,04%	1,60%
Indice	2,10%	2,44%	2,32%	2,11%	2,82%	2,18%	1,71%
Ecart	-0,15%	-0,28%	-0,17%	-0,15%	-0,10%	-0,14%	-0,11%

[1] Les données supérieures à un an sont annualisées.

PERFORMANCES NETTES PAR ANNÉE CIVILE *(Source : Fund Admin)* [2]

	2025	2024	2023	2022	2021
Portefeuille	2,13%	3,73%	3,11%	-0,23%	-0,63%
Indice	2,24%	3,77%	3,29%	-0,03%	-0,56%
Ecart	-0,11%	-0,04%	-0,18%	-0,20%	-0,07%

[2] Les performances passées ne sont pas constantes dans le temps et ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. Les investissements sont soumis aux fluctuations de marché et peuvent varier à la hausse comme à la baisse.

WAM et WAL (en jours, source : Amundi)

	WAM *	WAL **
30/10/2026	6	138
30/09/2026	5	157
31/08/2026	5	159
31/07/2026	7	165
30/06/2026	6	148
29/05/2026	7	134
30/04/2026	9	127
31/03/2026	9	149
27/02/2026	11	133
30/01/2026	13	138
31/12/2025	6	136
28/11/2025	7	141

** WAL (Weighted Average Life) : Durée de vie moyenne pondérée (DVMP) exprimée en nombre de jours

* WAM (Weighted Average Maturity) : Maturité moyenne pondérée (MMP) exprimée en nombre de jours

Indicateur(s) glissant(s) (Source : Fund Admin)

	1 an	3 ans	5 ans
Volatilité du portefeuille	0,03%	0,12%	0,21%
Volatilité de l'indice	0,03%	0,11%	0,20%
Tracking Error ex-post	0,01%	0,01%	0,02%

* La volatilité est un indicateur statistique qui mesure l'amplitude des variations d'un actif autour de sa moyenne. Exemple : des variations de +/- 1,5% par jour sur les marchés correspondent à une volatilité de 25% par an.

Indicateurs (Source : Amundi)

	Portefeuille
Sensibilité Taux *	0,01
Note moyenne	AA-
Nombre de lignes	390
Nombre d'émetteurs	94

* La sensibilité (en points) représente le changement en pourcentage du prix pour une évolution de 1% du taux de référence.

* Source : Fund Admin. Les performances sont calculées dans la devise de référence, sur des données historiques. Les performances affichées sont nettes de frais de gestion. (1) Les performances calendaires couvrent des périodes complètes de 12 mois pour chaque année civile. Les performances sont annualisées sur une base de 360 jours sur une période < 1 an et 365 jours sur une période > 1 an (exprimées à l'arrondi supérieur). La valeur des investissements peut varier à la hausse ou à la baisse selon l'évolution des marchés.

La décision de l'investisseur d'investir dans le fonds visé doit tenir compte de toutes les caractéristiques ou de tous les objectifs du fonds. Rien ne garantit que les considérations ESG amélioreront la stratégie d'investissement ou la performance d'un fonds.

BFT AUREUS ISR - P

MONÉTAIRE 31/10/2026



Julien Levy
Gérant de portefeuille



Johan Margueret
Gérant de portefeuille

Commentaire de gestion

Le mois d'octobre 2026 a été marqué par une nouvelle flambée des prix de l'énergie. En effet, les attaques contre des navires se sont poursuivies dans le détroit d'Ormuz, les Houthis ont revendiqué des frappes contre plusieurs raffineries saoudiennes et Donald Trump a laissé entendre que les frappes américaines sur l'Iran pourraient reprendre après les élections de mi-mandat du 3 novembre. Le baril de brent a ainsi progressé de près de 14% sur le mois, à 118 $, soit son plus haut niveau depuis six mois. Le prix du gaz naturel a, lui aussi, très fortement augmenté pour atteindre son plus haut niveau depuis la fin de l'année 2022. L'autre fait marquant du mois a été le net repli des valeurs technologiques en toute fin de mois, après des publications de résultats décevantes d'Alphabet, Amazon et Intel, qui ont ravivé les doutes sur la rentabilité des investissements massifs dans l'IA.
Les indices d'inflation publiés en octobre, portant sur le mois de septembre, ont de nouveau accéléré sous l'effet des prix de l'énergie. En zone euro, l'inflation totale a atteint 3,8% contre 3,2% en août, soit son plus haut niveau depuis septembre 2023, la composante énergie progressant de 18,8% sur un an. En revanche, l'inflation sous-jacente est restée globalement stable, à 2,5%. Aux Etats-Unis, l'inflation totale (CPI) est passée de 3,4% à 3,7%, alors que l'inflation sous-jacente est remontée à 2,6%, un peu plus que prévu. L'inflation « core PCE » de septembre est, elle, ressortie à 3,1%.
Les indicateurs d'activité ont continué à être de bonne facture. Aux Etats-Unis, la croissance du PIB au T3 est ressortie à 3,4% en variation trimestrielle annualisée, au-dessus des attentes, portée par la consommation et l'investissement des entreprises. Toutefois, après une bonne publication en août, le rapport sur l'emploi de septembre a déçu, avec seulement 29 000 créations d'emplois non-agricoles et une remontée du taux de chômage à 4,2%. En zone euro, le PIB a progressé de 0,4% au T3, malgré une contraction surprise de 0,1% en France, mais le PMI composite a reculé à 51,9 en octobre, contre 53,1 en septembre, nettement en dessous des attentes. En Chine, la croissance du PIB est ressortie à 4,5% en glissement annuel au T3, mais l'économie reste très déséquilibrée et la consommation des ménages très faible.
Après septembre, premier mois de l'histoire au cours duquel la BCE, la Fed et la BoJ ont toutes les trois relevé leurs taux directeurs, ces trois banques centrales ont toutes décidé de laisser leurs taux inchangés en octobre. La Fed a maintenu la fourchette cible des fed funds à 3,75/4%, mais deux membres du FOMC (Lisa Cook et Beth Hammack) ont voté en faveur d'une nouvelle hausse. Kevin Warsh a indiqué que la hausse de taux de septembre avait commencé à produire ses effets et que le durcissement des conditions financières allait dans le sens d'une période de croissance et de stabilité des prix plus durable. De son côté, la BoJ a laissé son principal taux directeur à 1,25% mais ouvert la porte à une hausse en décembre. Enfin, la BCE a laissé son taux de dépôt à 2,50%, alors même que les prix de l'énergie en Europe se situent désormais entre les scénarios « adverse » et « sévère » évoqués en septembre, ce qui alimente les risques haussiers pour l'inflation et baissiers pour la croissance. Le Conseil a débattu d'une nouvelle hausse de taux mais a jugé les incertitudes encore trop fortes, tout en indiquant que « la direction est assez claire » pour tous ses membres. Il ne voit pas pour le moment de risque substantiel d'effets de second tour.
Malgré la hausse du pétrole, les rendements obligataires ont nettement baissé sur le mois, profitant de la recherche de valeurs refuges en fin de mois et de la pause des banques centrales. Le taux 10 ans américain a reculé de près de 40 bps, à 4,90%, après avoir dépassé brièvement 5,30% au cours du mois. Le taux 10 ans allemand a baissé d'environ 25 bps sur le mois, à 3,29%, retrouvant ses niveaux de fin août. Au Japon, le taux 10 ans est repassé sous la barre des 3%, à 2,77%, son plus bas niveau depuis près de trois mois. Enfin, l'or a de nouveau reculé, d'environ 6% sur le mois, à un peu plus de 3 875 $ l'once, pénalisé par la perspective de hausses de taux de la Fed à venir.

Sur le marché monétaire, les niveaux de swap €STR sont en hausse de 2 bps pour le swap 3 mois à 2.54 % et de -11 bps pour le swap 1 an à 2.87 %.
Les spreads des émetteurs bancaires sur le marché monétaire des NeuCP sont en nette hausse sur le mois . Les spreads des banques françaises affichent des niveaux moyens de ESTR +40 bps sur les maturités d'un an et de ESTR +30 bps sur les maturités de six mois.
Les taux à l'émission des émetteurs Corporates s'établissent à +276 bps sur des maturités 3 mois, en hausse sur le mois, soit un spread moyen vs Swap ESTR 3 mois à +22 bps.
A fin octobre, le fonds affiche une durée de vie moyenne (WAL) de 138 jours, en baisse de 19 jours sur le mois. La sensibilité taux (WAM) du fonds s'inscrit à 6 jours, stable sur le mois.
Les liquidités et les OPCVM Monétaires représentent 28.5 % du fonds, en hausse sur le mois lié à un fort mouvement de souscription sur le mois. L'exposition sur les émetteurs bancaires s'établit à 64.5 %, en baisse de 3.5 %, celle des émetteurs Corporates s'établit à 6.4%, stable.
Sur le mois, nous avons investi 2100 M€, dont 1450 M€ sur les Financières et 650 M€ sur des émetteurs Corporates. La WAL des investissements du mois (hors JJ) est de 249 jours, en baisse par rapport au mois précédent.
La note moyenne ESG du fonds s'établit à C, au-dessus de son univers d'investissement retranché de 30% des émetteurs les moins bien notés.

COMPOSITION DU PORTEFEUILLE *(Source : Groupe Amundi)*

Principales lignes (Source : Amundi)

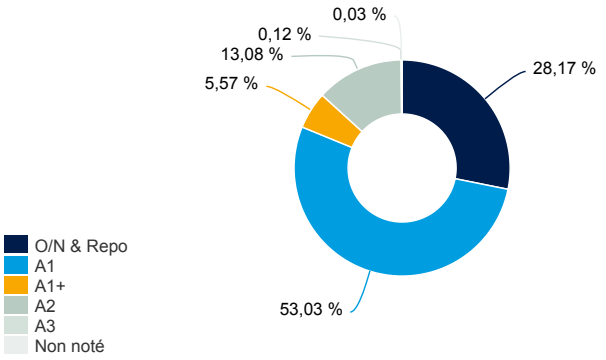
	Portefeuille	Maturité	Pays	Groupe d'instrument	Contrepartie *
BPCE SA	0,87%	12/08/2027	France	Monétaire	-
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV	0,69%	31/12/2026	Italie	Monétaire	-
UNICREDIT SPA	0,50%	03/03/2027	Italie	Monétaire	-
BPCE SA	0,45%	22/07/2027	France	Monétaire	-
BPCE SA	0,44%	09/02/2027	France	Monétaire	-
BANQUE FED CREDIT MUTUEL	0,43%	15/03/2027	France	Monétaire	-
NATIXIS SA	0,43%	17/09/2027	France	Monétaire	-
CREDIT INDUS ET COMMERCIAL SA	0,42%	25/01/2027	France	Monétaire	-
BANQUE FED CREDIT MUTUEL	0,42%	23/02/2027	France	Monétaire	-
CREDIT AGRICOLE SA	0,41%	07/05/2027	France	Monétaire	-

* Pour les prises en pension, la maturité affichée correspond au temps nécessaire pour déboucler l'opération
* Colonne contrepartie: information uniquement disponible pour les prises en pension

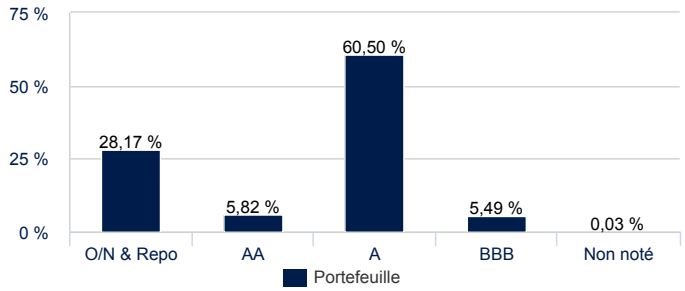
BFT AUREUS ISR - P

MONÉTAIRE 31/10/2026

Répartition par notations court terme (Source : Amundi) *



Répartition par notations long terme (Source : Amundi)



* Rating médian calculé des trois agences de notation de crédit: Fitch, Moody's et Standard & Poor's. En vue de la sélection des titres, la gestion ne s'appuie ni exclusivement, ni mécaniquement sur les notations émises par les agences de notation; elle s'appuie principalement sur l'expertise des équipes de BFT .

Rating médian calculé des trois agences de notation de crédit: Fitch, Moody's et Standard & Poor's. En vue de la sélection des titres, la gestion ne s'appuie ni exclusivement, ni mécaniquement sur les notations émises par les agences de notation; elle s'appuie principalement sur l'expertise des équipes de BFT .

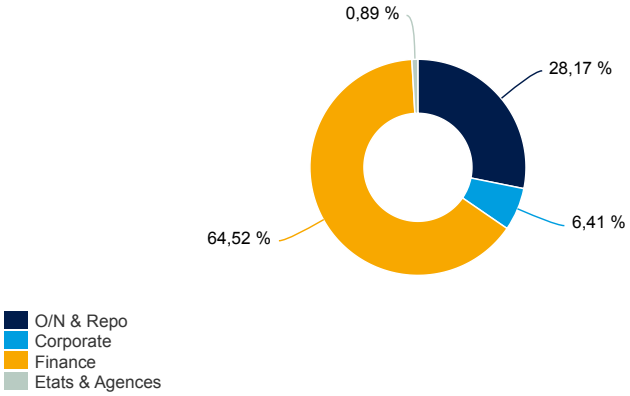
Ratio de Liquidités * (Source : Amundi)

Actifs à échéance journalière	**22,53%**
Actifs à échéance hebdomadaire	**30,75%**

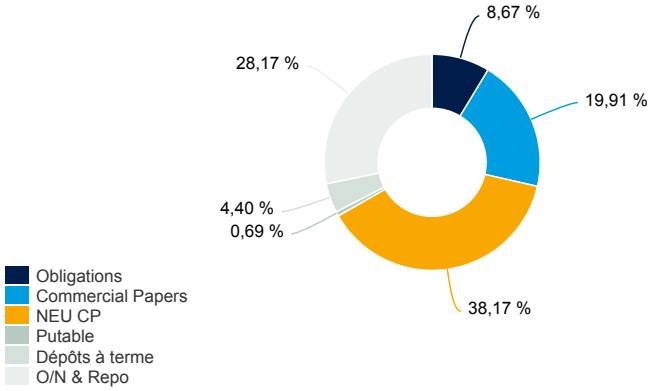
***RÈGLEMENT (UE) 2017/1131 sur les Fonds Monétaires**

Pour les fonds monétaires standard, au moins 7,5 % de ses actifs sont à échéance journalière ou sont constitués d'accords de prise en pension auxquels il peut être mis fin moyennant un préavis d'un jour ouvrable ou de liquidités dont le retrait peut être effectué moyennant un préavis d'un jour ouvrable; au moins 15 % de ses actifs sont à échéance hebdomadaire ou sont constitués d'accords de prise en pension auxquels il peut être mis fin moyennant un préavis de cinq jours ouvrables ou de liquidités dont le retrait peut être effectué moyennant un préavis de cinq jours ouvrables.

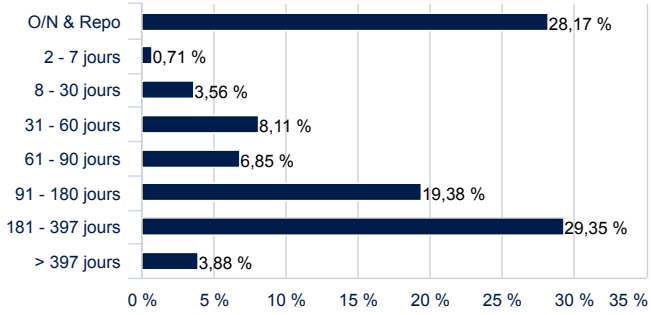
Répartition du portefeuille - Secteurs (Source : Amundi)



Répartition du portefeuille - Types d'instruments (Source : Amundi)



Répartition par maturité (Source : Amundi) *



* O/N & Repo : liquidités placées au jour le jour

BFT AUREUS ISR - P

MONÉTAIRE

31/10/2026

Matrice Notations long terme / Maturités (Source : Amundi)

	AA	AA-	A+	A	A-	BBB+	BBB	BBB-	Non noté	O/N & Repo	Total
0-4 mois	0,93%	0,96%	16,99%	1,16%	2,81%	2,41%	0,63%	0,12%	-	26,38%	52,41%
4-12 mois	1,79%	1,86%	28,76%	2,30%	5,15%	0,75%	0,63%	-	-	1,79%	43,04%
12-18 mois	0,10%	-	1,08%	0,64%	0,21%	0,13%	-	-	-	-	2,16%
18-24 mois	0,15%	0,03%	0,60%	0,78%	-	0,12%	0,68%	-	0,03%	-	2,39%
Total	2,96%	2,85%	47,44%	4,89%	8,17%	3,42%	1,95%	0,12%	0,03%	28,17%	100%

Rating médian calculé des trois agences de notation de crédit: Fitch, Moody's et Standard & Poor's. En vue de la sélection des titres, la gestion ne s'appuie ni exclusivement, ni mécaniquement sur les notations émises par les agences de notation; elle s'appuie principalement sur l'expertise des équipes de BFT .

Matrice Pays / Secteurs / Maturités (Source : Amundi)

	0-1 mois	1-3 mois	3-6 mois	6-12 mois	1-2 ans	N/A	Total
Zone Euro	**3,61%**	**14,93%**	**17,46%**	**23,65%**	**2,13%**	**-**	**61,77%**
Autriche	-	-	-	0,42%	-	-	0,42%
Finance	-	-	-	0,42%	-	-	0,42%
Belgique	0,32%	0,32%	0,21%	0,61%	0,16%	-	1,62%
Finance	0,32%	0,32%	0,21%	0,61%	0,16%	-	1,62%
Finlande	0,39%	0,18%	0,43%	0,73%	-	-	1,73%
Finance	0,39%	0,18%	0,43%	0,73%	-	-	1,73%
France	1,98%	10,23%	10,86%	14,18%	1,74%	-	39,00%
Corporate	0,46%	0,84%	0,66%	0,26%	0,51%	-	2,72%
Finance	0,95%	9,40%	10,13%	13,93%	0,99%	-	35,39%
Etats & Agences	0,58%	-	0,07%	-	0,24%	-	0,89%
Allemagne	0,13%	0,32%	0,20%	0,14%	-	-	0,78%
Corporate	0,13%	-	-	-	-	-	0,13%
Finance	-	0,32%	0,20%	0,14%	-	-	0,66%
Irlande	-	0,08%	-	-	-	-	0,08%
Finance	-	0,08%	-	-	-	-	0,08%
Italie	0,42%	2,10%	2,93%	1,76%	-	-	7,21%
Corporate	0,09%	0,81%	0,05%	0,24%	-	-	1,19%
Finance	0,34%	1,30%	2,88%	1,51%	-	-	6,02%
Luxembourg	-	0,28%	0,64%	1,19%	-	-	2,11%
Corporate	-	0,14%	0,25%	-	-	-	0,38%
Finance	-	0,14%	0,40%	1,19%	-	-	1,72%
Pays-Bas	0,07%	0,77%	1,40%	3,22%	0,24%	-	5,70%
Corporate	0,07%	-	-	-	0,12%	-	0,20%
Finance	-	0,77%	1,40%	3,22%	0,11%	-	5,50%
Portugal	-	0,10%	-	-	-	-	0,10%
Corporate	-	0,10%	-	-	-	-	0,10%
Espagne	0,29%	0,55%	0,79%	1,40%	-	-	3,02%
Corporate	-	0,07%	-	-	-	-	0,07%
Finance	0,29%	0,48%	0,79%	1,40%	-	-	2,96%
Reste du monde	**0,84%**	**0,21%**	**1,84%**	**4,74%**	**2,42%**	**-**	**10,05%**
Canada	-	-	0,24%	0,77%	1,07%	-	2,08%
Finance	-	-	0,24%	0,77%	1,07%	-	2,08%
Japon	-	-	-	0,25%	0,26%	-	0,51%
Corporate	-	-	-	-	0,14%	-	0,14%
Finance	-	-	-	0,25%	0,12%	-	0,37%
Suède	0,40%	0,21%	0,36%	1,77%	0,34%	-	3,08%
Corporate	-	-	-	-	0,34%	-	0,34%
Finance	0,40%	0,21%	0,36%	1,77%	-	-	2,74%
Royaume-Uni	0,44%	-	1,24%	1,62%	0,07%	-	3,37%
Corporate	0,07%	-	-	0,06%	-	-	0,13%
Finance	0,37%	-	1,24%	1,56%	0,07%	-	3,24%
États-Unis	-	-	-	0,33%	0,68%	-	1,01%
Corporate	-	-	-	0,33%	0,68%	-	1,01%
O/N & repo	**22,53%**	**3,85%**	**1,79%**	**-**	**-**	**-**	**28,17%**

BFT AUREUS ISR - P

MONÉTAIRE 31/10/2026

Caractéristiques principales (Source : Amundi)

Forme juridique	Fonds Commun de Placement (FCP)
Droit applicable	de droit français
Société de gestion	CPR ASSET MANAGEMENT
Dépositaire	CACEIS Bank
Date de création de la classe	31/08/2015
Devise de référence de la classe	EUR
Classification AMF	Monétaire standard
Affectation des sommes distribuables	(C) Capitalisation (D) Distribution
Code ISIN	(C) FR0012903250 (D) FR0012903268
Code Bloomberg	-
Souscription minimum: 1ère / suivantes	1 Part(s) / 1 millième part(s)/action(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Limite de réception des ordres	Ordres reçus chaque jour J avant 12:25
Frais d'entrée (maximum)	0,00%
Frais Gestion Financiere Direct	0,45% TTC
Commission de surperformance	Oui
Commission de surperformance (% par an)	30,00%
Frais de sortie (maximum)	0,00%
Frais de gestion et autres coûts administratifs ou d'exploitation	0,39%
Coûts de transaction	0,02%
Frais de conversion	
Durée minimum d'investissement recommandée	1 jour à 1 mois
Historique de l'indice de référence	01/04/2021: 100.00% ESTR CAPITALISE (OIS) 02/01/2012: 100.00% EONIA CAPITALISE (O.I.S.) (BASE 360) - DISCONTINUED 14/04/2008: 100.00% EONIA CAPITALISE (J) (BASE 360) (BFT)
Norme européenne	OPCVM
Cours connu/inconnu	Cours inconnu
Date de valeur rachat	J
Date de valeur souscription	J
Particularité	OPCVM maître

Votre fonds présente un risque de perte en capital supporté par l'investisseur. Sa valeur liquidative peut fluctuer et le capital investi n'est pas garanti. Le fonds ne peut en aucun cas s'appuyer sur un soutien extérieur pour garantir ou stabiliser sa valeur liquidative. Investir dans un fonds monétaire est différent d'un investissement dans des dépôts bancaires.

Label ISR

Le label ISR est un outil pour choisir des placements responsables et durables. Créé et soutenu par le ministère des Finances, le label a pour objectif de rendre plus visibles les produits d'investissement socialement responsables (ISR) pour les épargnants en France et en Europe. Le label ISR est attribué par un organisme de certification qui audite le compartiment lequel doit respecter une série de critères définis par le cahier des charges du label (https://www.lelabelisr.fr/).

Classification SFDR*

Ce compartiment reprend dans son process d'investissement des caractéristiques environnementales ou sociales ou une combinaison des deux, mais il n'a pas pour objectif l'investissement durable. Pour plus d'informations, veuillez vous référer à l'Annexe précontractuelle disponible sur le site internet CPRAM, la Politique d'Investissement Responsable de CPRAM et la Déclaration du Règlement SFDR d'Amundi. **La décision d'investir dans le compartiment visé doit prendre en compte l'ensemble des caractéristiques et objectifs du compartiment**.

** Le règlement (UE) 2019/2088 du parlement européen et du conseil du 27 novembre 2019 « SFDR » est relatif à la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers.*

BFT AUREUS ISR - P

MONÉTAIRE 31/10/2026

Avertissement

Document simplifié et non contractuel, destiné à être remis exclusivement aux porteurs de parts. Les caractéristiques principales du fonds sont mentionnées dans sa documentation juridique, disponible sur le site de l'AMF ou sur simple demande au siège social de la société de gestion. La documentation juridique vous est remise avant toute souscription à un fonds. Investir implique des risques : les valeurs des parts ou actions des OPC sont soumises aux fluctuations du marché, les investissements réalisés peuvent donc varier tant à la baisse qu'à la hausse. Par conséquent, les souscripteurs des OPC peuvent perdre tout ou partie de leur capital initialement investi. Il appartient à toute personne intéressée par les OPC, préalablement à toute souscription, de s'assurer de la compatibilité de cette souscription avec les lois dont elle relève ainsi que des conséquences fiscales d'un tel investissement et de prendre connaissance des documents réglementaires en vigueur de chaque OPC. La source des données du présent document est Amundi sauf mention contraire. La date des données du présent document est celle indiquée en tête du document sauf mention contraire.

BFT AUREUS ISR - P

MONÉTAIRE

31/10/2026

Lexique ESG

Investissement Socialement Responsable (ISR)

L'ISR traduit les objectifs du développement durable dans les décisions d'investissements en ajoutant les critères Environnementaux, Sociaux et de Gouvernance (ESG) en complément des critères financiers traditionnels.

L'ISR vise ainsi à concilier performance économique et impact social et environnemental en finançant les entreprises et les entités publiques qui contribuent au développement durable quel que soit leur secteur d'activité. En influençant la gouvernance et le comportement des acteurs, l'ISR favorise une économie responsable.

Critères ESG

Il s'agit de critères extra-financiers utilisés pour évaluer les pratiques Environnementales, Sociales et la Gouvernance des entreprises, Etats ou collectivités :

« E » pour Environnement (niveau de consommation d'énergie et de gaz, gestion de l'eau et des déchets…).
« S » pour Social/Sociétal (respect des droits de l'homme, santé et sécurité au travail…).
« G » pour Gouvernance (indépendance du conseil d'administration, respect des droits des actionnaires …).

Echelle de notation ESG

Echelle de notation de A (meilleure note) à G (moins bonne note)



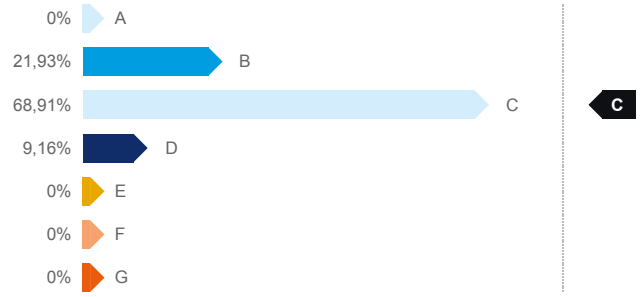
NOTE ESG MOYENNE (source : Amundi)

Notation Environnementale, Sociale et de Gouvernance. Les informations sur les aspects liés à la durabilité sont disponibles sur https://about.amundi.com/legal-documentation

Univers d'investissement ESG

75% ICE BOFA 1-3 YEAR EURO FINANCIAL INDEX + 25% ICE BOFA 1-3 YEAR EURO NON-FINANCIAL INDEX

Répartition du portefeuille par notation ESG[1]



Scores et Notes ESG

	Portefeuille	Indice
E Score	1,44	0,92
S Score	0,81	0,52
G Score	0,83	0,31
Score ESG moyen	1,19	0,66
Note ESG moyenne	C	C

Couverture de l'analyse ESG[1] (Source : Amundi)

% du portefeuille noté ESG[2]	100%

Label ISR

Niveau de durabilité (source : Morningstar)



Le niveau de durabilité est une notation produite par la société Morningstar qui vise à mesurer le niveau de responsabilité d'un fonds de façon indépendante sur la base des valeurs en portefeuille. La notation s'établit de très faible (un globle) à très élevé (5 globes). L'obtention de cette notation par le compartiment ne signifie pas que celui-ci réponde à vos propres objectifs en matière de durabilité.

MorningstarSustainabilityRatingDate : **31/08/2026**

Source Morningstar ©
Sustainability Score – sur la base des analyses de risques ESG fournies par Sustainalytics sur les entreprises, utilisées dans le calcul du score de durabilité de Morningstar.
© 2026 Morningstar. Tous droits réservés. Les informations contenues ici : (1) appartiennent à Morningstar et/ou ses fournisseurs de contenu ; (2) ne peuvent être reproduites ou redistribuées ; et (3) ne sont pas garanties d'exactitude, d'exhaustivité ou d'actualité. Ni Morningstar, ni ses fournisseurs de contenu ne sont responsables en cas de dommages ou de pertes liés à l'utilisation de ces informations. Les performances passées ne garantissent pas les résultats futurs. Pour plus d'informations sur le rating Morningstar, veuillez consulter leur site www.morningstar.com.

[1] Titres en circulation en fonction des critères ESG, hors liquidités.

La décision de l'investisseur d'investir dans le fonds promu doit tenir compte de toutes les caractéristiques ou objectifs du fonds.

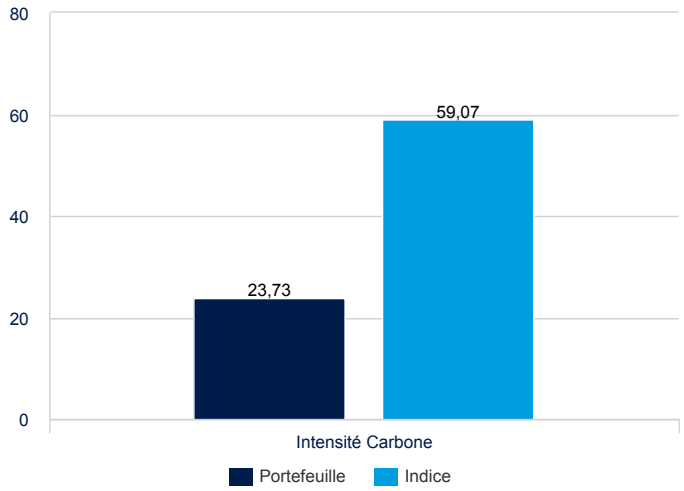
BFT AUREUS ISR - P

MONÉTAIRE 31/10/2026

Zoom sur des indicateurs Environnementaux, Sociaux et de Gouvernance

En complément de l'évaluation ESG globale du portefeuille et celle des dimensions E, S et G, le gérant utilise des indicateurs d'impact afin d'évaluer la qualité ESG du fonds sur les plans environnementaux, sociaux, de bonne gouvernance, et du respect des droits humains. A cette fin, quatre critères de performance ont été retenus et le fonds a pour objectif d'avoir un portefeuille affichant une meilleure performance que l'univers d'investissement de référence pour au moins deux de ces critères.

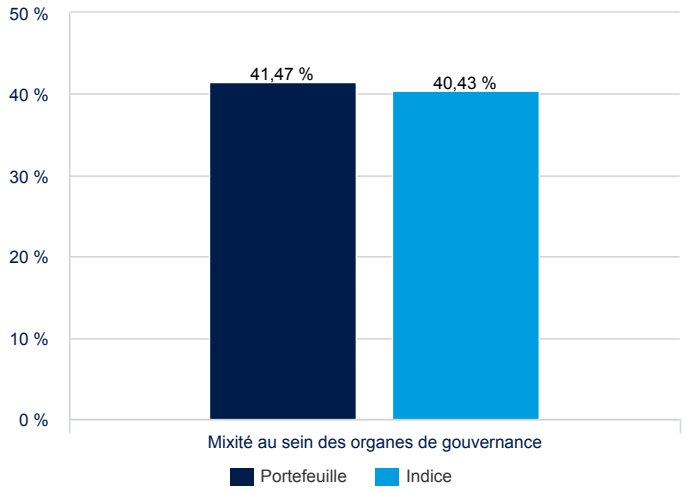
ENVIRONNEMENT : Intensité carbone



Intensité de gaz à effet de serre (GES) des sociétés bénéficiaires des investissements – tCO2eq/€m de revenues
Source : Trucost

Taux de couverture (Portefeuille/Indice)	98,77%	97,13%

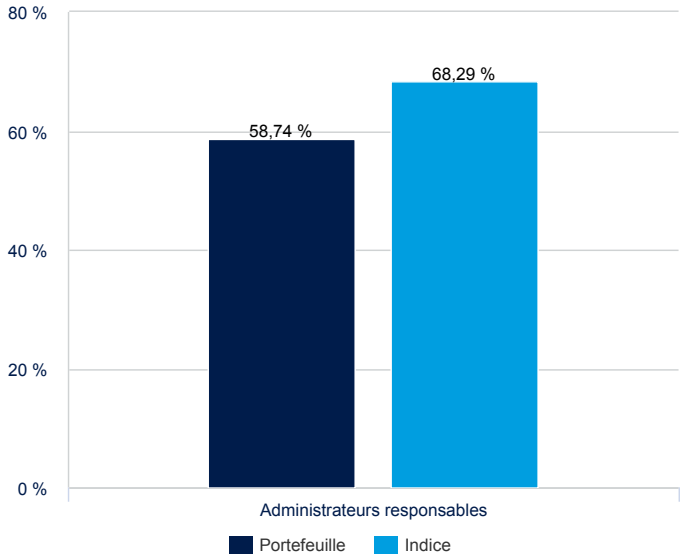
SOCIAL : Mixité au sein des organes de gouvernance



Part de femmes dans les organes de gouvernance des sociétés concernées, en pourcentage du nombre total de membres
Source : Refinitv, ISS, MSCI

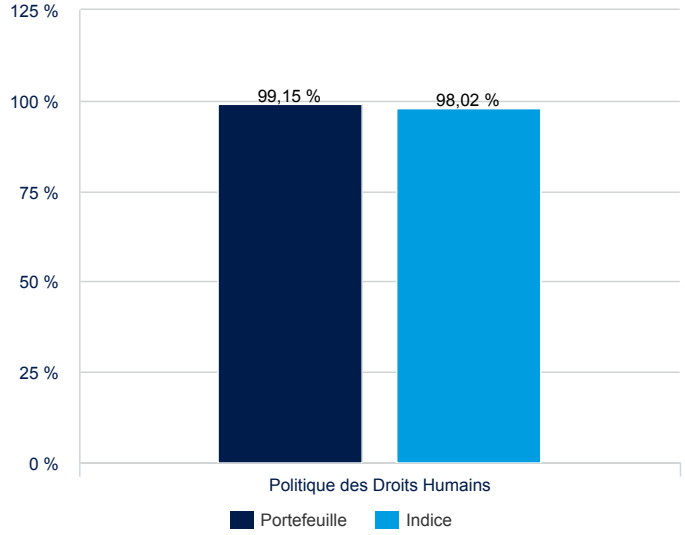
Taux de couverture (Portefeuille/indice)	98,77%	98,69%

GOUVERNANCE : Indépendance du Conseil d'Administration



Taux de couverture (Portefeuille/Indice)	84,34%	87,99%

RESPECT DES DROITS HUMAINS : travail décent et liberté d'association



Taux de couverture (Portefeuille/Indice)	84,34%	87,99%

Sources et définitions

Intensité carbone : Le PAI 3 mesure les Emissions carbone exprimées en M€ de chiffres d'affaires. L'intensité des Gaz à Effet de Serre du portefeuille est déterminée par le calcul de la moyenne pondérée du portefeuille de l'intensité totale des émissions de gaz à effet de serre par million d'euros de chiffre d'affaires des entreprises du portefeuille (t/EUR millions d'euros de chiffre d'affaires).

Amundi s'appuie sur le fournisseur de données S&P-Trucost dont la méthodologie est basée sur le Greenhouse Gas Protocol :
Le Scope 1 : Emissions directes induites par les ressources possédées ou contrôlées par l'entreprise.
Le Scope 2 : Emissions indirectes induites par l'achat ou la production d'électricité, de vapeur ou de chaleur.
Le Scope 3 : L'ensemble de toutes les autres émissions indirectes, en amont et en aval de la chaîne de valeur. Pour des raisons de robustesse des données, nous avons choisi d'utiliser les émissions provenant des activités en amont du scope 3.

Mixité au sein des organes de gouvernance : Le % de diversité de genre du conseil d'administration du portefeuille est déterminé en calculant la moyenne pondérée du portefeuille du pourcentage de membres du conseil d'administration qui sont des femmes dans les entreprises détenues, exprimée en pourcentage de tous les membres du conseil d'administration. L'indicateur PAI utilise l'approche "Investissements pertinents", ce qui signifie que le dénominateur est déterminé en considérant uniquement les investissements concernés par l'indicateur. Lorsque la couverture de la diversité des genres dans les conseils d'administration est inférieure à 100 %, les pondérations du portefeuille sont ajustées pour tenir compte de la couverture incomplète des données. Source de données : Refinitiv, ISS, MSCI et CRISIL.

Indépendance du Conseil d'Administration : Pourcentage moyen d'administrateurs indépendants dans les Conseils d'Administration. Fournisseur de données : Refinitiv.

Respect des Droits Humains : Pourcentage d'entreprises ayant une politique d'exclusion du travail des enfants, forcé ou obligatoire, ou garantissant la liberté d'association, appliquée universellement et indépendamment des lois locales.