Informations relatives au produit publiées sur le site internet conformément à l'article 10(1) du Règlement SFDR pour les fonds classés article 8 au sens dudit Règlement

RESUME

Dénomination du produit :
CPR ES EUROPE DEFENSE

Legal entity identifier:
213800KN7GHPVW98YO15

Absence d'objectif d'investissement durable

Ce produit financier fait la promotion de caractéristiques environnementales ou sociales mais n'a pas pour objectif l'investissement durable.

Caractéristiques environnementales ou sociales du produit financier

Le fonds est investi en totalité et en permanence en actions I EUR – ACC de son Compartiment Maître CPR Invest – Europe Defense de la SICAV CPR Invest (le « Compartiment Maître »). **Par conséquent, les caractéristiques environnementales et sociales du Fonds doivent être lues conjointement avec celles du Compartiment Maître.**

Le Compartiment Maître promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales en visant un score ESG plus élevé que le score ESG de son univers d'investissement.

Pour déterminer le score ESG du Compartiment Maître et de l'univers d'investissement, la performance ESG est évaluée en comparant la performance moyenne d'un titre au secteur de l'émetteur du titre, au regard de chacune des trois caractéristiques ESG (critères environnementaux, sociaux et de gouvernance).

L'univers d'investissement du Compartiment Maître est un univers conçu sur mesure sur la base des piliers spécifiques au thème d'investissement qui n'évalue pas ou n'inclut pas les composants en fonction de caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'est donc pas obligatoirement conforme aux caractéristiques promues par le Compartiment Maître.

Allocation d'actifs

Au moins 75% des titres et instruments du Compartiment Maître seront utilisés pour répondre aux caractéristiques environnementales ou sociales promues, conformément aux éléments contraignants de la stratégie d'investissement du Compartiment Maître.

Contrôle des caractéristiques environnementales ou sociales, méthodes applicables et sources (y compris leurs limites), diligences mises en œuvre et politiques d'engagement

Toutes les données extra-financières, externes comme internes, sont centralisées par la Ligne Métier Investissement Responsable qui est chargée de contrôler la qualité des données reçues et de leur diffusion. Ce contrôle comprend un contrôle de qualité automatisé ainsi qu'un contrôle qualitatif effectué par des analystes ESG spécialistes de leur secteur. Les scores ESG sont mis à jour mensuellement dans l'outil de notation propriétaire d'Amundi (module Stock Rating Integrator (SRI)).

Les indicateurs de développement durable utilisés par Amundi reposent sur des méthodologies

propriétaires. Ces indicateurs sont disponibles en permanence dans le système de gestion de portefeuille, ce qui permet aux gérants d'évaluer l'impact de leurs décisions d'investissement.

De plus, ces indicateurs sont intégrés dans le processus de contrôle d'Amundi, les responsabilités étant réparties entre le premier niveau de contrôle effectué par les équipes d'investissement elles-mêmes et le second niveau de contrôle effectué par les équipes de risques, qui surveillent en permanence le respect des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le fonds.

La notation ESG d'Amundi utilisée pour déterminer le score ESG est un score quantitatif ESG traduit en sept notes, allant de A (les meilleurs scores de l'univers) à G (les plus mauvais). Dans l'échelle de notation ESG d'Amundi, les titres appartenant à la liste d'exclusion correspondent à un score de G. Pour les émetteurs corporate, la performance ESG est évaluée globalement et en fonction de critères pertinents par comparaison avec la performance moyenne de son secteur d'activité, à travers la combinaison des trois dimensions ESG.

La méthodologie de notation appliquée par Amundi ESG rating repose sur 38 critères soit génériques (communs à toutes les entreprises quelle que soit leur activité), soit sectoriels, pondérés par secteur et considérés en fonction de leur impact sur la réputation, l'efficacité opérationnelle et la réglementation d'un émetteur. Les ratings ESG d'Amundi sont susceptibles d'être exprimés globalement sur les trois dimensions E, S et G ou individuellement sur tout facteur environnemental ou social.

Les scores ESG d'Amundi sont construits en utilisant le cadre d'analyse ESG et la méthodologie de notation d'Amundi. A cette fin, nous utilisons les données sources suivantes : Moody, ISS-Oekem, MSCI et Sustainalytics.

Les limites de notre méthodologie sont par construction liées à l'utilisation des données ESG. Le paysage des données ESG est en cours de normalisation, ce qui peut avoir un impact sur la qualité des données ; la couverture des données est également une limite. La réglementation actuelle et future améliorera la standardisation des reportings et les déclarations des entreprises sur lesquelles les données ESG reposent.

Nous sommes conscients de ces limites que nous atténuons par une combinaison d'approches.

Chaque mois, les scores ESG sont recalculés selon la méthodologie quantitative d'Amundi. Le résultat de ce calcul est ensuite revu par les analystes ESG qui effectuent un "contrôle d'échantillonnage" qualitatif de son secteur sur la base de diverses vérifications.

Amundi mène une politique d'engagement auprès des émetteurs (dans lesquels nous sommes investis et ceux sur lesquels nous pourrions potentiellement investir) quel que soit le type de participations détenues (actions et obligations).