

Caractéristiques

Date de création	25/11/2019	Date du dernier rebalancement	18/12/2023
Indice	Refinitiv Eurozone ESG Select Index	Indice de comparaison	Euro Stoxx 50 PR
Code Bloomberg	RFTREES Index	Code Bloomberg	SX5E Index

• Objectifs de l'indice

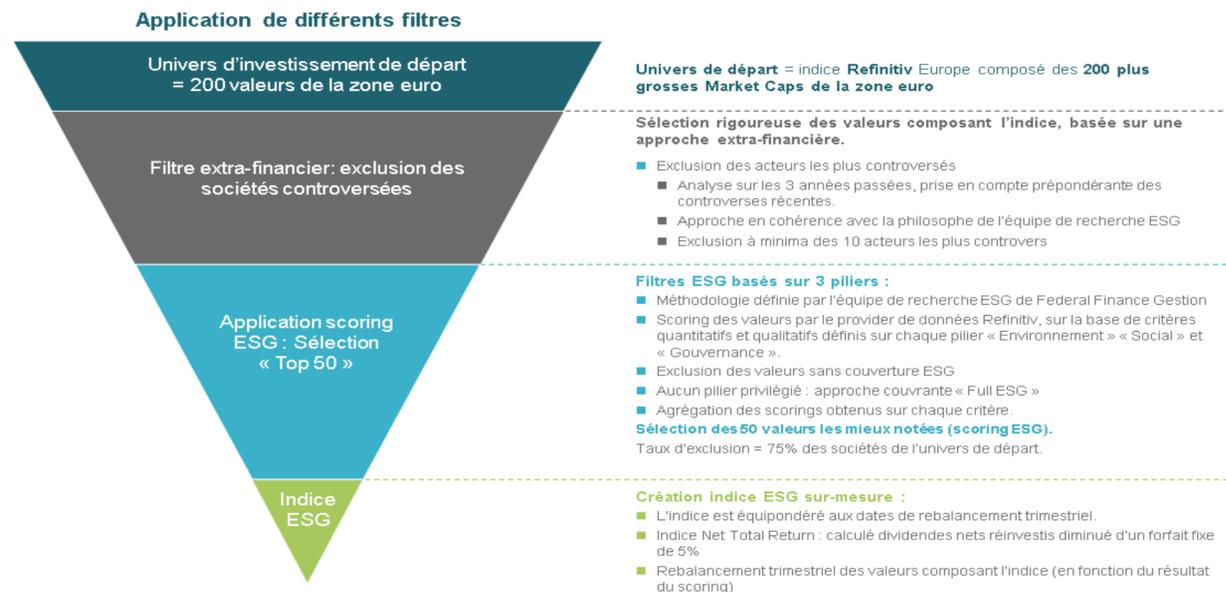
L'indice Refinitiv Eurozone ESG Select Index est composé d'actions de la zone euro, sélectionnées en fonction de leurs pratiques environnementales, sociales et de gouvernance (ESG).

• Méthode de construction de l'indice

Il s'agit d'un indice des marchés actions de la zone euro, calculé, mis à jour et publié par Refinitiv qui présente les caractéristiques suivantes :

- a) Parmi les 200 plus grandes capitalisations boursières de la zone Euro, sont exclues les entreprises les plus controversées selon une notation controversée obtenue par application de la méthodologie développée par Refinitiv, sur la base d'un cahier des charges établi par l'équipe de recherche ESG de Federal Finance Gestion.
- b) Les entreprises restantes sont évaluées selon une notation « ESG » (Environnement, Social et Gouvernance) permettant de classer les entreprises selon l'impact environnemental de leurs activités, la qualité de leurs relations sociales (droit du travail, respect des droits de l'Homme, etc...) et la qualité de leur gouvernance. Les scores ESG sont calculés, mis à jour et publiés par Refinitiv. Les 50 sociétés les mieux notées sont intégrées dans l'indice. Par ailleurs, si plusieurs entreprises possèdent le même score ESG, elles seront toutes retenues au sein de l'indice, qui peut ainsi contenir plus de 50 valeurs.
- c) L'indice pondère de façon équivalente l'ensemble de ses constituants. Ainsi, si l'indice contient 50 valeurs, chaque action représente 2% du poids global de l'indice à chaque date de revue trimestrielle, sans impact liée à la capitalisation boursière.
- d) L'indice est calculé en réinvestissant les dividendes nets détachés par les actions qui le composent et en retranchant un montant forfaitaire de 5% par an. Si les dividendes distribués sont inférieurs (respectivement, supérieurs) au niveau du montant forfaitaire, la performance de l'indice en sera amoindrie (respectivement, améliorée) par rapport à un indice à dividendes non réinvestis.

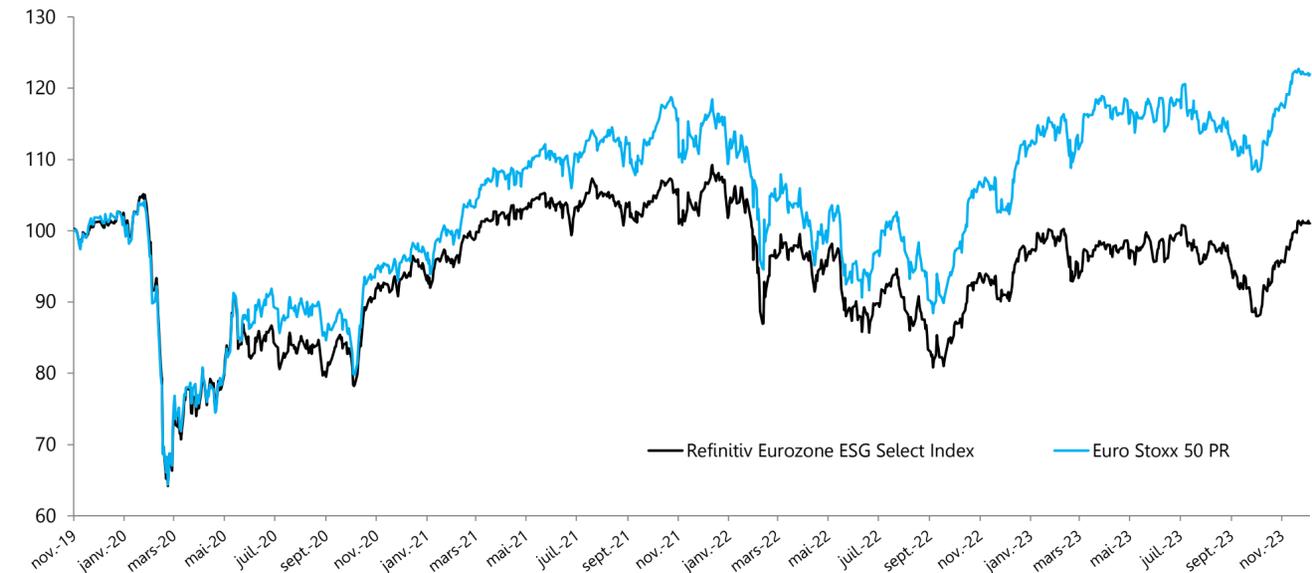
Processus de création de l'indice



Performances au 29.12.2023

	Depuis création	YTD	Rebalancement
Refinitiv Eurozone ESG Select Index	1,03%	12,08%	0,24%
Euro Stoxx 50 PR	21,95%	19,19%	0,01%

Performances historiques des indices benchmark, base 100 au 25.11.2019

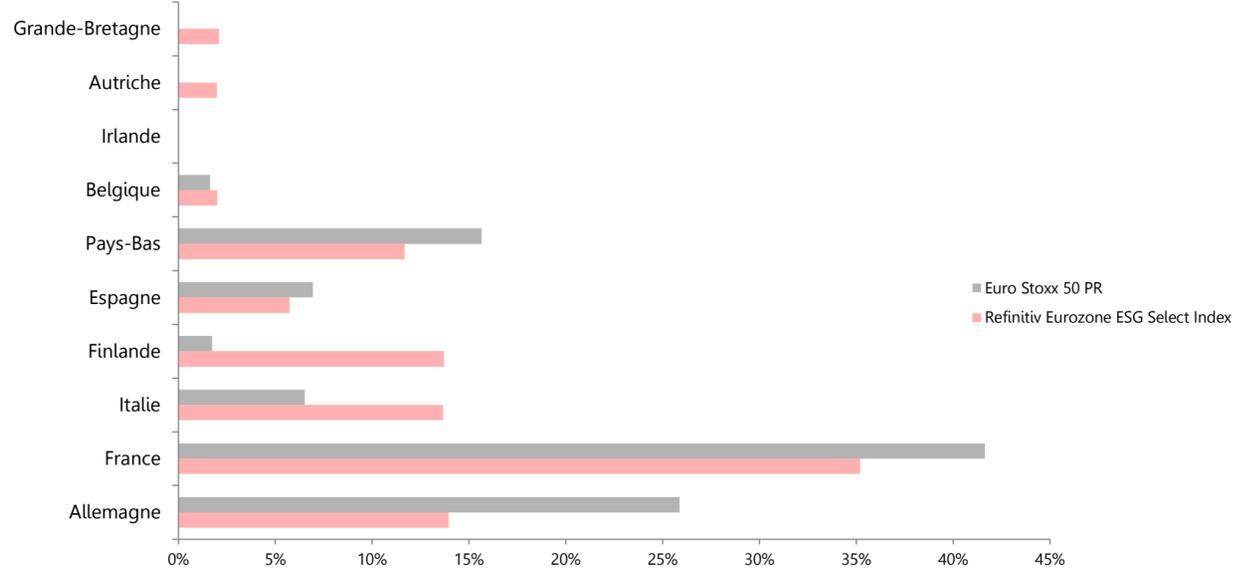


Statistiques

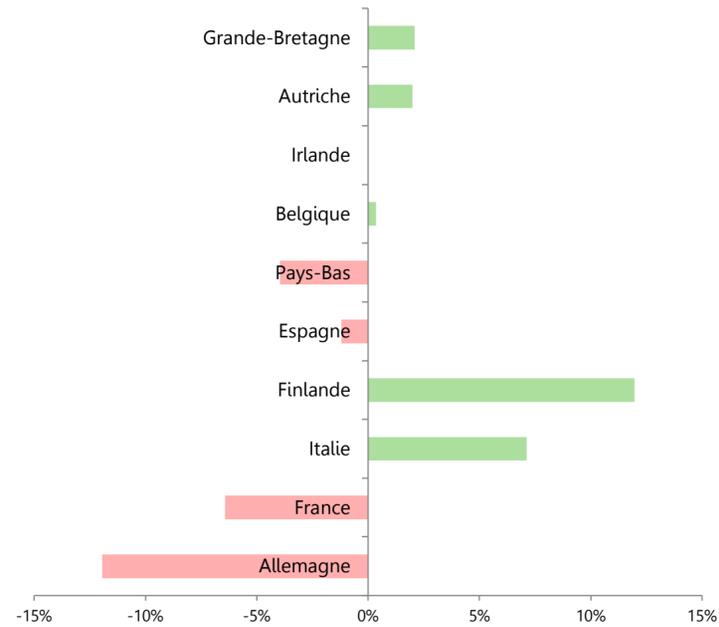
Refinitiv Eurozone ESG Select Index			
Active Share	76,89%	Tracking Error (depuis création)	5,90%
Overlap	23,11%	Beta (depuis création)	0,92
Volatilité (depuis création)	22,80%	Drawdown (depuis création)	-38,95%
Euro Stoxx 50 PR			
Volatilité (depuis création)	24,04%	Drawdown (depuis création)	-38,27%

Portefeuille

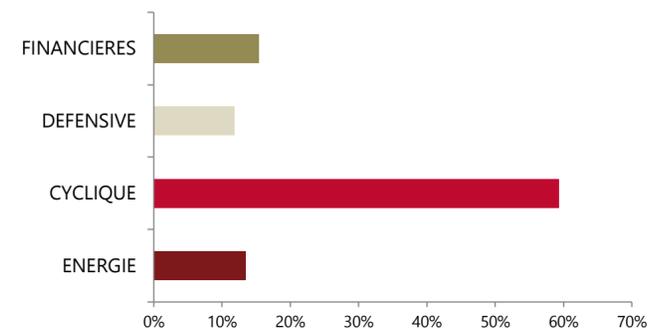
R partition g ographique au 29.12.2023



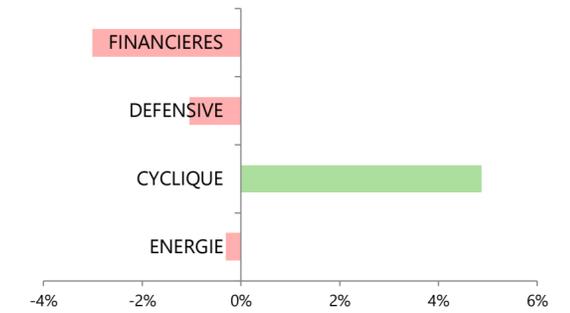
G ographique - sous-jacent vs Euro Stoxx 50 au 29.12.2023



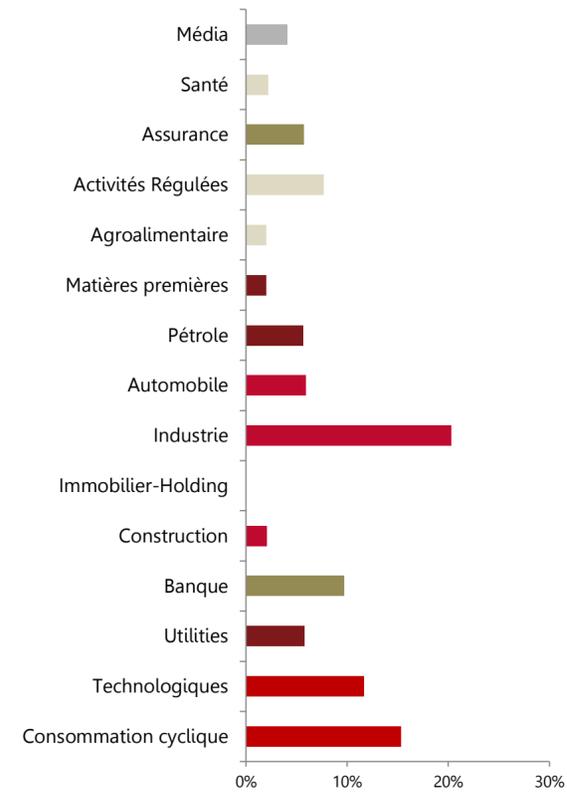
Secteur - sous-jacent au 29.12.2023



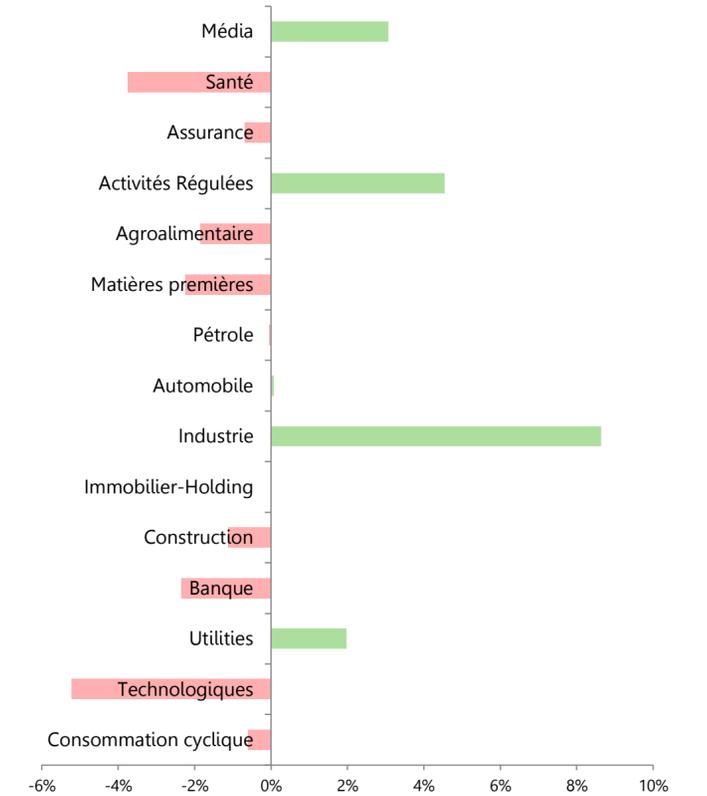
Secteur - sous-jacent vs Euro Stoxx 50 au 29.12.2023



Sous Secteur - sous-jacent au 29.12.2023



Sous Secteur - sous-jacent vs Euro Stoxx 50 au 29.12.2023



Détail des lignes dans le RFTREES Index

Nom	Isin	Nom	Isin
AEGON LTD	BMG0112X1056	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	FR0000125007
AMADEUS IT GROUP SA	ES0109067019	SIEMENS AG	DE0007236101
ASM INTERNATIONAL NV	NL0000334118	SOCIETE GENERALE SA	FR0000130809
ASML HOLDING NV	NL0010273215	SNAM SPA	IT0003153415
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	NL0012866412	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	FR0013154002
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	DE0005190003	STMICROELECTRONICS NV	NL0000226223
CAPGEMINI SE	FR0000125338	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE	IT0003242622
CNH INDUSTRIAL NV	NL0010545661	UMICORE	BE0974320526
CONTINENTAL AG	DE0005439004	UPM-KYMMENE OYJ	FI0009005987
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	DE000DTR0CK8	VIVENDI SE	FR0000127771
ENDESA SA	ES0130670112		
ELISA OYJ	FI0009007884		
ENEL SPA	IT0003128367		
FINECOBANK SPA	IT0000072170		
GEA GROUP AG	DE0006602006		
ASSICURAZIONI GENERALI	IT0000062072		
GETLINK SE	FR0010533075		
HERMES INTERNATIONAL	FR0000052292		
ING GROEP NV	NL0011821202		
INTESA SANPAOLO	IT0000072618		
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	ES0148396007		
KONE OYJ-B	FI0009013403		
KONINKLIJKE KPN NV	NL0000009082		
LEGRAND SA	FR0010307819		
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	FR0000121014		
MICHELIN (CGDE)	FR001400AJ45		
MTU AERO ENGINES AG	DE000A0D9PT0		
NORDEA BANK ABP	FI4000297767		
NESTE OYJ	FI0009013296		
NOKIA OYJ	FI0009000681		
OMV AG	AT0000743059		
ORANGE	FR0000133308		
L'OREAL	FR0000120321		
PERNOD RICARD SA	FR0000120693		
KERING	FR0000121485		
PRYSMIAN SPA	IT0004176001		
PUBLICIS GROUPE	FR0000130577		
PUMA SE	DE0006969603		
REXEL SA	FR0010451203		
SAMPO OYJ-A SHS	FI4000552500		
SCHNEIDER ELECTRIC SE	FR0000121972		

AVERTISSEMENT

La présente publication est diffusée uniquement à titre d'information et ne constitue ni une proposition d'investissement ni un conseil en investissement. Ce document et son contenu vous sont adressés à titre personnel et confidentiel. Ces données sont la propriété exclusive de l'administrateur d'indice. Elles ne peuvent être réutilisées et/ou diffusées auprès de tiers sans l'accord préalable et exprès du(des) administrateur(s) d'indice(s). Il ne s'agit ni d'une offre, ni d'une invitation de la part de Federal Finance Gestion, à acheter ou vendre des titres ou des instruments financiers ou à participer à une stratégie de négoce particulière dans une juridiction quelconque. Ce document a été établi sans tenir compte des objectifs, de la situation financière et des besoins d'un investisseur en particulier. Il décrit des performances passées qui ne préjugent en rien des performances futures. Les informations présentées ont été obtenues et étayées à partir de sources que Federal Finance Gestion estime fiables, cependant, aucune garantie n'est donnée quant à leur exactitude et leur exhaustivité. Federal Finance Gestion ne s'engage pas à mettre à jour ces informations après leur publication et décline toute responsabilité pour toute perte découlant de l'utilisation de ce document. Les informations contenues dans le présent document peuvent être modifiées sans préavis.

Les produits utilisant l'indice ne sont pas sponsorisés, approuvés ou promotionnés par Refinitiv limited ou toutes ses filiales ou affiliées («Refinitiv»). Refinitiv ne fait aucune représentation ou garantie, expresse ou implicite, aux propriétaires du ou des produit(s) ou à tout membre du public concernant l'avisabilité d'investir dans ces produits ou en la capacité du Refinitiv Eurozone ESG Select Index pour suivre la performance générale du marché. La seule relation de Refinitiv avec le(s) produit(s) est l'indice, qui est déterminé, composé et calculé par Refinitiv. Refinitiv n'a aucune obligation de prendre en compte les besoins du licencié ou des propriétaires du ou des produit(s) dans ces cadres d'exercice. Refinitiv n'est pas responsable et n'a pas participé à la détermination du calendrier, des prix ou des quantités du ou des produit(s) à démarrer ou à la détermination ou au calcul de l'équation par laquelle le(s) produit(s) doit être converti en espèces. Refinitiv n'a aucune obligation ou responsabilité relative à l'administration, à la commercialisation ou à la négociation du ou des produit(s).

Refinitiv ne garantit pas la qualité, la précision et/ou l'intégralité de l'indice ou des données qui y comprennent. Refinitiv n'offre aucune garantie, expresse ou implicite, quant aux résultats à obtenir par le licencié, les propriétaires du ou des produit(s) ou toute autre personne ou entité de l'utilisation de l'indice ou de toutes les données qui y comprennent. Refinitiv n'offre aucune garantie expresse ou implicite, et décline expressément toute garantie de qualité marchande ou d'adaptation à un usage particulier concernant l'indice ou toutes ses données. Refinitiv ne sera en aucun cas responsable pour toute perte de profits, dommages spéciaux, indirects, accessoires ou consécutifs même si notifié de la possibilité de tels dommages.

Source du document : Bloomberg, Federal Finance Gestion et Refinitiv (<https://www.refinitiv.com/en>)