

CONSTRUCTION DE L'INDICE

- **Objectifs de l'indice**

L'indice est défini sur la base d'un univers de valeurs listées dans les marchés développés mondiaux de larges et moyennes capitalisations dans lequel sont sélectionnées les 40 grandes entreprises affichant une création brute d'emploi en France ou présentant les meilleures pratiques sur un score Emploi.

- Méthode de construction de l'indice

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

1. L'univers d'investissement de départ est un univers large de grande et moyenne capitalisation de marchés développés (Euronext® Developed Market Index).
2. De cet univers d'investissement ne sont retenues uniquement que les valeurs libellées en EUR, USD, CAD, GBP et JPY et qui respectent les critères de liquidité quotidienne minimale (supérieure à 10 millions d'euros par jour), la liquidité étant entendue comme la moyenne des montants échangés sur les 3 derniers mois.
3. Ensuite, les entreprises qui ne respectent pas les normes internationales (« Global Compact » des Nations Unies), ou qui extraient un certain niveau de leur chiffre d'affaires du charbon, du pétrole ou du gaz, ou encore qui sont impliquées dans des activités contestables (armes controversées, production et distribution de tabac) sont ensuite exclues à leur tour.
4. Un second filtre consiste à exclure les sociétés classées dans la section NACE à Fort Impact Climatique et non approuvées Science Based Targets.
5. Un premier filtre spécifique d'exclusion Layoff est appliqué. Il s'agit d'un indicateur qui a pour but de mesurer si une entreprise investissant en France a été identifiée comme étant impliquée dans un programme de licenciement dans les 6 mois précédents. Par ailleurs, tout entreprise non couverte par cet indicateur est également exclue.
6. Un deuxième filtre spécifique d'exclusion Emploi est appliqué. Sont exclues les entreprises faisant partie des 20% moins bonnes performances selon une approche sectorielle et géographique. Ce score Emploi est basé sur une évaluation des performances dans les principaux domaines de la durabilité sociale, notamment la liberté d'association, l'égalité des chances, la santé et la sécurité, l'équilibre entre vie professionnelle et vie privée, la sécurité de l'emploi, ainsi que la formation et l'éducation.
7. Dans l'univers investissable ainsi défini l'indice se compose de 20 titres de la zone France et 20 titres de la zone Reste du monde ayant la création brute d'emploi la plus élevée en France au cours des 3 dernières années. En cas de nombre de titres insuffisant sur la création brute d'emploi, la sélection se fait sur le score Emploi.
8. L'indice est pondéré par capitalisation boursière flottante avec un poids de 50% par zone et un poids maximum individuel de 10% à chaque rebalancement.
9. La recomposition de l'indice est trimestrielle. 100% des dividendes nets sont réinvestis et un prélèvement de 5% forfaitaire est extrait chaque année. L'ensemble des données extra financières sont fournies par ISS-ESG et SESAMM.

EN RÉSUMÉ

TICKER BLOOMBERG

FRDEV40 Index

DATE DE LANCEMENT

16/08/2024

AGENT DE CALCUL

Euronext

UNIVERS DE RÉFÉRENCE

Actions Monde

DEVISE

Euro (non couvert)

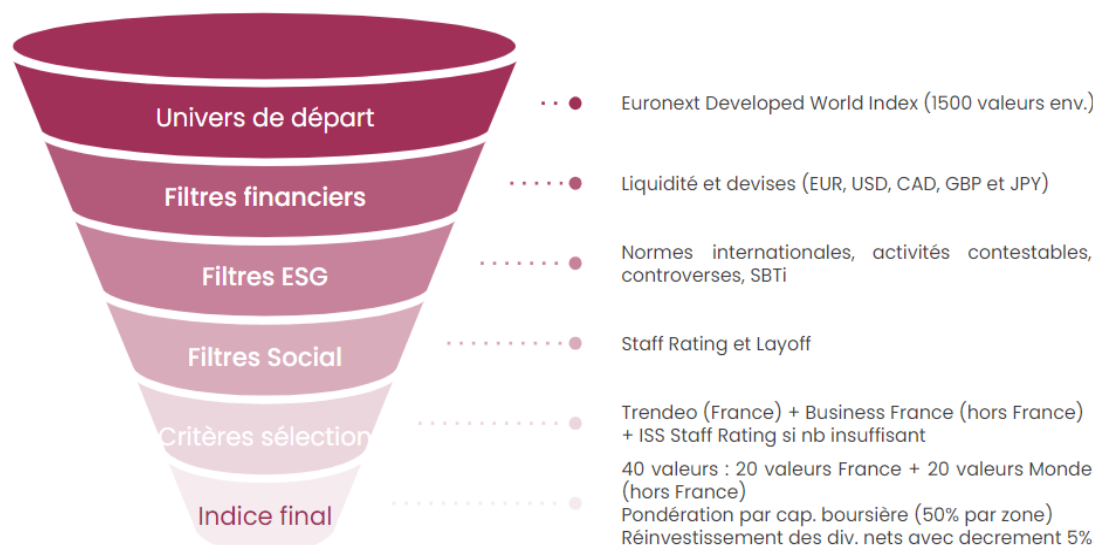
FRÉQUENCE REBALANCEMENT

Trimestrielle

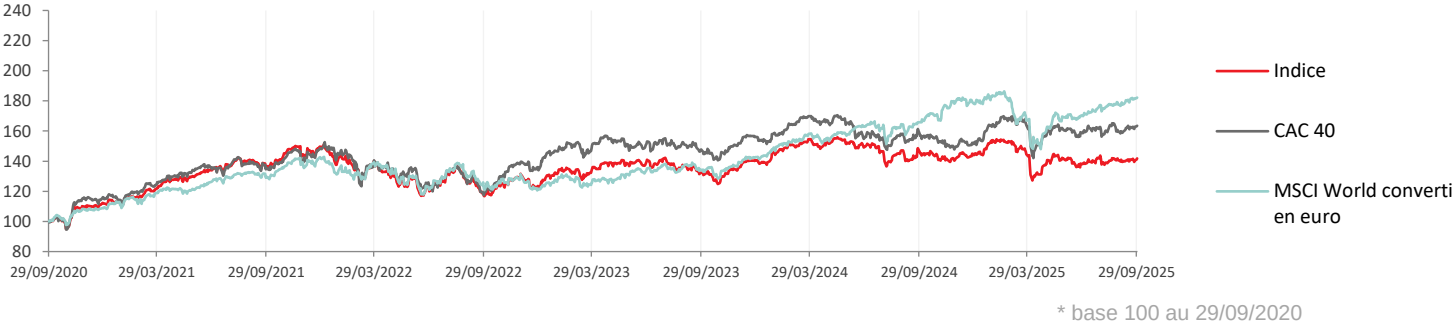
DIVIDENDE SYNTHÉTIQUE

5%

PROCESSUS DE CRÉATION DE L'INDICE



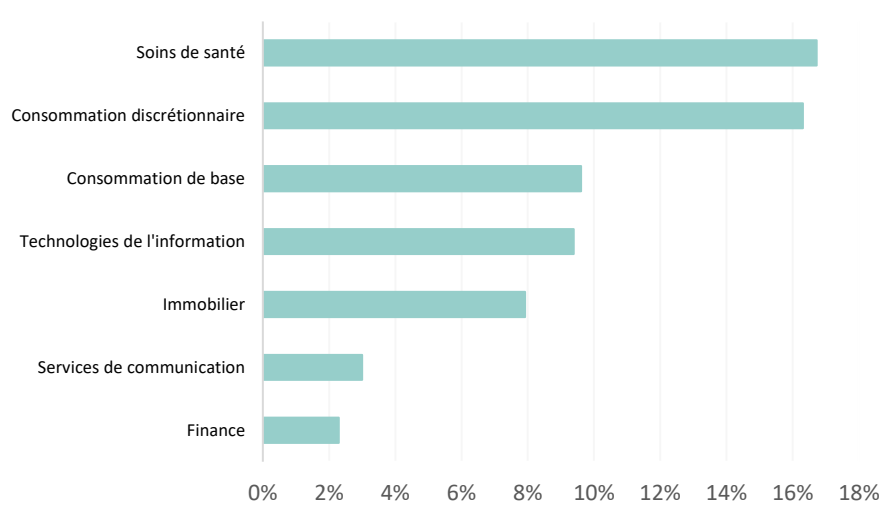
COMPARAISON DES PERFORMANCES



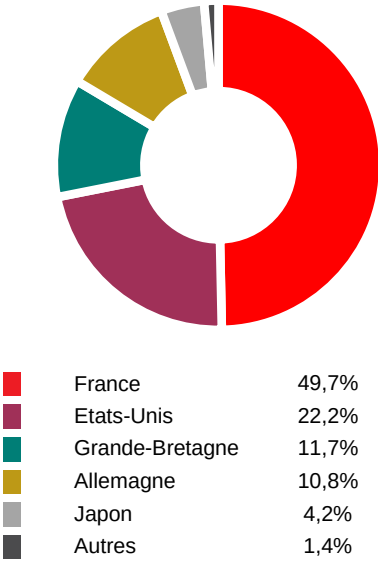
INDICATEURS DE PERFORMANCES DU PORTEFEUILLE (DEPUIS 29/09/2020)

	Rendement annualisé	Volatilité	Sharpe	Max drawdown
Indice	7,24%	14,66%	0,49	-22,98%
CAC 40	10,31%	16,67%	0,62	-23,04%
MSCI World (converti en euro)	12,74%	14,11%	0,90	-20,54%

RÉPARTITION SECTORIELLE



RÉPARTITION GÉOGRAPHIQUE



PRINCIPALES LIGNES DU PORTEFEUILLE

Nom	Secteur	Pays	Poids
GENERAL ELECTRIC	Industrie	Etats-Unis	10,0%
SCHNEIDER ELECTRIC SE	Industrie	France	8,8%
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	Consommation discrétionnaire	France	8,4%
ASTRAZENECA PLC	Soins de santé	Grande-Bretagne	7,3%
SIEMENS AG-REG	Industrie	Allemagne	6,4%
SANOFI	Soins de santé	France	5,9%
L'OREAL	Consommation de base	France	5,7%
ACCENTURE PLC-CL A	Technologies de l'information	Etats-Unis	4,8%
HERMES INTERNATIONAL	Consommation discrétionnaire	France	4,2%
PROLOGIS INC	Immobilier	Etats-Unis	3,3%

Sources du document : Bloomberg, Arkéa Asset Management et Euronext

* Liste complète présente sur le site d'Euronext

Données arrêtées au 30/09/2025



Le présent document est purement informatif et ne constitue ni une offre de souscription, d'achat ou de toute autre transaction portant sur les instruments qui y sont visés, ni un conseil personnalisé d'investissement. Les futurs investisseurs doivent entreprendre les démarches nécessaires afin de déterminer eux-mêmes et/ou avec le concours de leurs conseillers l'adéquation de leur investissement, en fonction des considérations légales, fiscales et comptables qui leur sont applicables ainsi que leur sensibilité aux risques inhérents aux instruments financiers.

Euronext ne garantit pas la qualité, la précision et/ou l'intégralité de l'indice ou des données qui y comprennent. Euronext 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. Euronext 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. Euronext 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.

Arkéa Asset Management SA à Directoire et Conseil de Surveillance. Siège social : 1, allée Louis Lichou
29480 LE RELECQ-KERHUON Siren 438 414 377 RCS Brest. Agrément de l'Autorité des Marchés Financiers – n° GP 01-036 – TVA : FR 64 438 414 377