

Politique Biodiversité

Notre modèle Bio & notre engagement

Juillet 2024

Table des matières

Notre approche « Biodiversité » et le modèle « BIO ».....	3
Notre méthodologie	3
Exemple pour une société	4
Le modèle « BIO » pour nos fonds	4
Notre engagement Biodiversité	4

Notre approche « Biodiversité » et le modèle « BIO »

Tout comme le Climat (cf notre politique climatique), la biodiversité peut se révéler porteuse de risques financiers non négligeables sur les investissements que nous réalisons. Nous identifions trois risques principaux :

- Les risques physiques d'exploitation (pénuries d'eau, de forêts...)
- Les risques de transition (modification des règles environnementales impactant le business model des sociétés)
- Les risques de réputation (controverse liée à une mauvaise gestion d'un risque Biodiversité...).

Dans le but d'évaluer l'exposition de ses OPC de la Gestion Collective au risque Biodiversité et en l'absence de données encore standardisées ou de réelle méthodologie disponible, Amplegest a choisi de construire un outil propriétaire qui sera conduit à évoluer au fil du temps.

Notre méthodologie

Notre modèle propriétaire « Bio » cherche à mesurer le niveau d'exposition de chaque société et de chaque fonds au thème de la Biodiversité au travers de quatre indicateurs (Source MSCI Research) exprimant :

- Le niveau d'exposition à la biodiversité
- La part des activités réalisées dans des zones sensibles
- L'existence d'engagements à réduire l'impact Biodiversité
- L'existence de controverses environnementales

Chacun des quatre indicateurs mentionnés ci-dessus est noté sur une échelle de 1 à 4 (4 étant la meilleure note, 1 la moins bonne note) et reçoit une couleur de drapeau (rouge =1, orange = 2, jaune =3, vert =4).

Pour chaque valeur, la note finale Biodiversité est la somme équipondérée (à 25%) de chaque indicateur. Elle reçoit une couleur de drapeau (cf ci-dessus).

Exemple pour une société

UNILEVER PLC				
Drapeau Biodiversité	Exposition...	 dont dans des zones sensibles	Engagements	Controverses environnementales

Le modèle « BIO » pour nos portefeuilles

Pour chaque fonds, la note finale est la somme des notes de toutes les positions pondérées par la taille des positions. La note finale est également exprimée sous forme de drapeau.

déc-23	Drapeau Biodiversité	Exposition...	 dont dans des zones sensibles	Engagements	Controverses environnementales
Amplegest Pricing Power					
Couverture	98%	100%	93%	100%	100%
Amplegest Pricing Power US					
Couverture	100%	100%	100%	100%	100%
Amplegest PME					
Couverture	35%	38%	27%	38%	38%
Amplegest MidCaps					
Couverture	85%	88%	74%	88%	88%
Amplegest Digital Leaders					
Couverture	99%	100%	95%	100%	100%
Adara					
Couverture	88%	91%	79%	91%	91%
Amplegest Long/Short					
Couverture	89%	93%	79%	93%	93%

Notre engagement Biodiversité

Dans l'attente d'une amélioration des données disponibles, Amplegest a choisi de s'engager en matière Biodiversité en retenant l'objectif de ne pas détenir de portefeuille « Rouge », c'est-à-dire de fonds dont la note moyenne pondérée serait inférieure à 1.5.