

Actions mondiales ESG systématique

APERÇU DE LA STRATÉGIE | 30 SEPTEMBRE 2024



Sommaire

- Portefeuille investi dans des entreprises cheffes de file sur un ensemble de critères environnementaux, sociaux et de gouvernance :
 - Sélection basée sur des filtres négatifs et positifs développés par l'équipe de recherche ESG de DGI.A.
 - Exclusion systématique des plus grands émetteurs de carbone, des détenteurs de réserves d'énergie fossile, des producteurs de charbon, et des titres de l'industrie du tabac et de l'armement.
 - Les entreprises qualifiées sont des leaders dans leur secteur d'activité selon plusieurs critères ESG.
- Approche systématique et modèle multifacteurs.
- Contrôle systématique du risque actif.

Indice de référence	MSCI Monde (net)
Objectif de valeur ajoutée	2 % (périodes mobiles 4 ans)
Cible de risque actif maximale	5 %
Cible de bêta vs indice	1,0 ($\pm 0,02$)
Nombre de titres	80 à 100
Gestion des devises (vs indice de référence)	Couverture 100 %
Intervalle de surpondération par titre	1,5 à 3 %
Encaisse maximale	2 %

Caractéristiques ESG

	Stratégie	MSCI Monde
Émissions de carbone (t CO ₂ / G\$ investi)	4	53
Intensité carbone (t CO ₂ / ventes)	7	104
Utilisation de l'eau (m ³ / M\$ ventes)	73	7 846
Ratio de recyclage (t recyclées / t produites)	68 %	64 %
Taux d'utilisation des énergies renouvelables	47 %	44 %
Taux de mortalité (par 100 000 employés)	0,5	0,7
Écart salarial (PDG / salaire moyen)	84	172
Rôles séparés pour PDG et président du C.A.	67 %	48 %
Pourcentage de femme au conseil d'administration	36 %	34 %

Source des données ESG des entreprises : Refinitiv

Rendements (% , CAD)

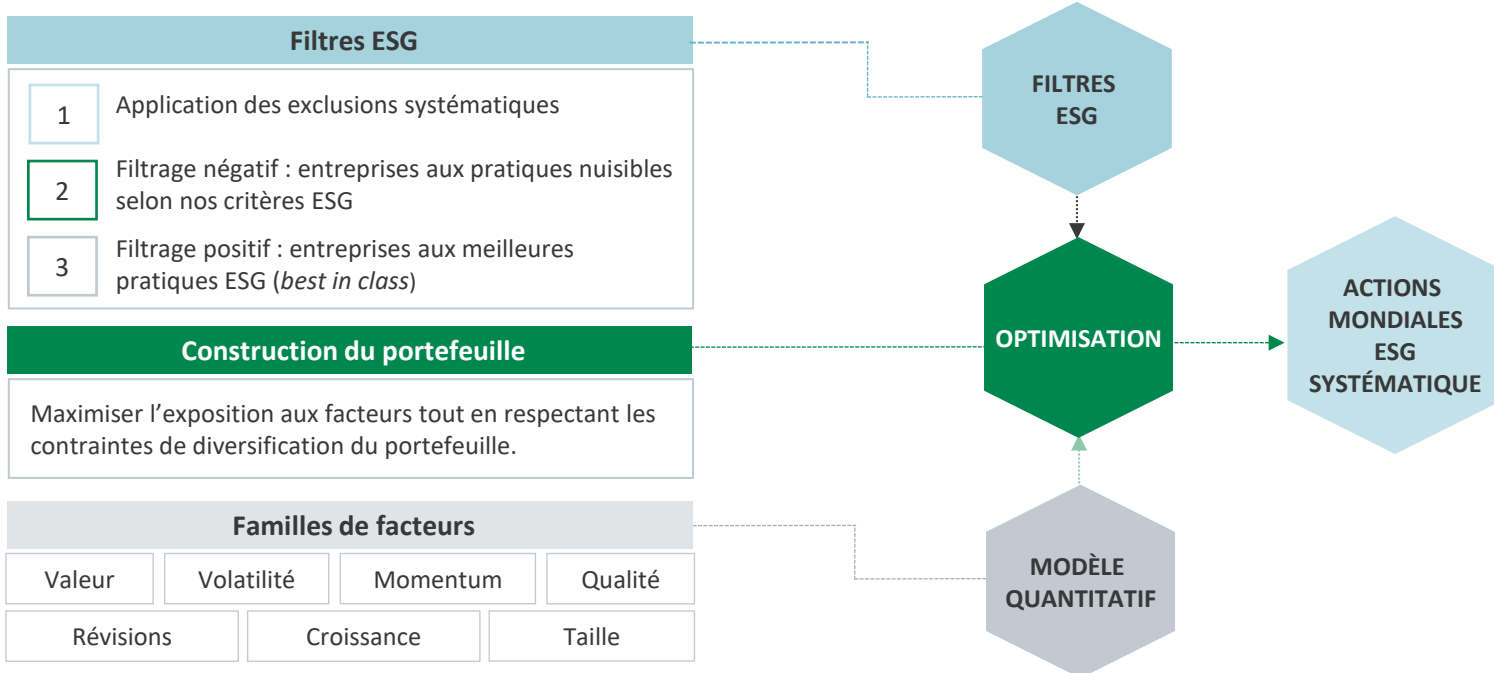
	3 mois	AAD	1 an	2 ans	3 ans	5 ans	10 ans	Depuis le début
Actions mondiales ESG systématique	0,99	25,56	39,00	29,64	11,21	14,78	---	15,85
MSCI Monde (net) ⁽¹⁾	5,01	21,71	32,32	26,01	11,44	12,99	---	13,28
VALEUR AJOUTÉE	-4,02	3,79	6,68	3,63	-0,23	1,79	---	2,57
	2019	2020	2021	2022	2023			
Actions mondiales ESG systématique	17,87	18,22	23,55	-17,92	23,53			
MSCI Monde (net) ⁽¹⁾	11,37	12,26	20,78	-12,19	20,47			
Valeur ajoutée	6,50	5,96	2,77	-5,73	3,06			

Note : La date de début est le 1^{er} juin 2019. Les rendements portant sur des périodes de plus de un an sont annualisés.

(1) L'indice de référence était couvert en \$US jusqu'au 31 décembre 2020.

Actions mondiales ESG systématique

Processus d'investissement



Équipe de gestion

Nelson Cabral, M.Sc., CFA

Gestionnaire de portefeuille
Expérience du placement : 17 ans
Membre de l'équipe depuis 2011

Jean-Michel Baillargeon, M.Sc., CFA

Gestionnaire de portefeuille
Expérience du placement : 14 ans
Membre de l'équipe depuis 2011

Yacine Jaa, M.Sc., CFA, FRM

Gestionnaire de portefeuille
Expérience du placement : 17 ans
Membre de l'équipe depuis 2008

Sofiane Tafat, Ph.D.

Conseiller principal
Expérience du placement : 13 ans
Membre de l'équipe depuis 2011

Gabriel Laprise, B.Ing., M.Sc.A., CFA

Conseiller principal
Expérience du placement : 5 ans
Membre de l'équipe depuis 2018

Recherche ESG

Véronique Marchetti, CFA

Analyste
Expérience du placement : 18 ans
Membre de l'équipe depuis 2010

Informations

FIRASS KANSOU

Directeur, Relations avec les consultants et la clientèle institutionnelle
firass.kansou@desjardins.com

Sources : MSCI, DGIA, au 30 septembre 2024

POUR INVESTISSEURS INSTITUTIONNELS CANADIENS SEULEMENT.

Les rendements présentés sont ceux d'un composé de portefeuilles investis dans des entreprises qui respectent les exigences de DGIA sur le plan ESG. La date de début du composé est le 1^{er} juin 2019. Les rendements sont présentés sur une base brute des frais de gestion et des frais administratifs, mais nette des frais de transaction. Les rendements passés ne permettent pas nécessairement de prévoir les rendements futurs. Les informations et les opinions exprimées dans ce document sont offertes à titre informatif seulement, et sont sujettes à changement selon les conditions du marché ou toute autre conjoncture. Aucune prise de décision de placements ne devrait reposer sur ces dernières. Les données ESG sur les entreprises sont fournies par Refinitiv. Ce document ne doit en aucun cas être considéré ou utilisé aux fins d'offre d'achat de parts dans un fonds ou de toute autre offre de titres, quelle que soit la juridiction. En aucun cas, ce document ne peut être reproduit, en tout ou en partie, sans avoir obtenu la permission écrite préalable de DGIA.