

Actions mondiales

ESG systématique



Sommaire de la stratégie

La stratégie regroupe des entreprises contribuant aux trois piliers de la durabilité, et leur alignement avec les ODD, selon une méthodologie élaborée par l'équipe IR de DGIA. Ces entreprises doivent également respecter des critères minimaux de gouvernance et de gestion des risques ESG.

Les titres liés au tabac, à l'armement, aux énergies fossiles, à l'alcool, aux jeux de hasard, au divertissement pour adultes ainsi que les entreprises aux pratiques jugées nuisibles sont exclus.

La stratégie s'appuie sur une approche systématique avec modèle multifactoriel et un contrôle rigoureux du risque actif.

| | |
|--------------------------------|----------------------------------|
| Indice | MSCI Monde (net) |
| Cible de valeur ajoutée | 2,0 % sur un cycle de quatre ans |
| Risque actif | Cible de 5 % |
| Bêta | Cible de 1,0 ($\pm 0,02$) |
| Devises | Couverture de 100 % |
| Titres | Surpondération entre 1,5 % à 3 % |
| Encaisse | Maximum de 2 % |
| Nombre de titres | 80 à 100 |

1^{er} juin 2019

Lancement de la stratégie

242 M\$

Actifs sous gestion dans la stratégie

26 février 2021

Création du fonds institutionnel

242 M\$

Actifs sous gestion dans le Fonds

Approche IR à trois volets

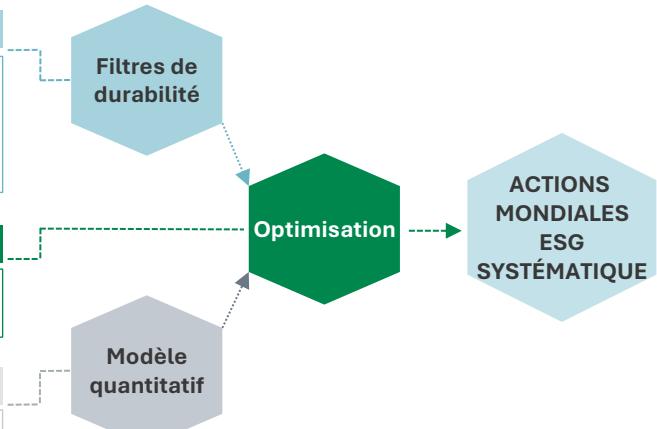
- 1 Pointage positif : entreprises considérées durables
- 2 Filtrage négatif : entreprises aux pratiques nuisibles selon nos critères de durabilité
- 3 Application des exclusions systématiques

Construction du portefeuille

Maximiser l'exposition aux facteurs tout en respectant les contraintes de diversification du portefeuille.

Familles de facteurs

Valeur Volatilité Qualité Croissance Taille Révisions Momentum



Rendements

| (En %) | 3 mois | Année à jour | 1 an | 2 ans | 3 ans | 5 ans | 10 ans | Depuis la création |
|-----------------------|-------------|--------------|-------------|---------------|-------------|-------------|-------------|--------------------|
| Portefeuille | 3,46 | 20,91 | 20,91 | 27,35 | 26,06 | 15,23 | --- | 17,12 |
| Indice | 1,59 | 15,41 | 15,41 | 22,22 | 21,64 | 13,80 | --- | 14,12 |
| Valeur ajoutée | 1,87 | 5,50 | 5,50 | 5,13 | 4,42 | 1,43 | --- | 3,00 |
| | 2025 | 2024 | 2023 | 2022 | 2021 | 2020 | 2019 | 2018 |
| Portefeuille | 20,91 | 34,13 | 23,53 | (17,92) | 23,55 | 18,22 | 17,87 | --- |
| Indice | 15,41 | 29,43 | 20,47 | (12,19) | 20,78 | 12,26 | 11,37 | --- |
| Valeur ajoutée | 5,50 | 4,70 | 3,06 | (5,73) | 2,77 | 5,96 | 6,50 | --- |

Les rendements présentés ceux d'un composé qui a débuté le 1^{er} juin 2019. Les rendements pour les périodes supérieures à 12 mois sont annualisés. L'indice de référence était couvert en \$US jusqu'au 31 décembre 2020.

Actions mondiales ESG systématique

Équipe d'investissement

Nelson Cabral, M.Sc., CFA

Gestionnaire de portefeuille

Expérience : 2007

Jean-Michel Baillargeon, M.Sc., CFA

Gestionnaire de portefeuille

Expérience : 2010

Yacine Jaa, M.Sc., CFA, FRM

Gestionnaire de portefeuille

Expérience : 2007

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

Gestionnaire de portefeuille

Expérience : 2018

Sofiane Tafat, Ph.D.

Conseiller principal, recherche quantitative

Expérience : 2011

Véronique Marchetti, CFA

Conseillère principale, investissement responsable

Expérience : 2005

Les gestionnaires de la stratégie collaborent avec l'équipe d'investissement responsable.

Statistiques ESG

| | Portefeuille | Indice |
|---|--------------|--------|
| Émissions de carbone (t CO ₂ / G\$ investi) | 6 | 38 |
| Intensité carbone (t CO ₂ / ventes) | 14 | 84 |
| Utilisation de l'eau (m ³ / M\$ ventes) | 286 | 11 457 |
| Ratio de recyclage (t recyclées / t produites) | 71 % | 65 % |
| Taux d'utilisation des énergies renouvelables | 50 % | 49 % |
| Taux de mortalité (par 100 000 employés) | 0,2 | 0,7 |
| Écart salarial (PDG / salaire moyen) | 209 | 143 |
| Rôles séparés pour PDG et président du C.A. | 61 % | 52 % |
| Pourcentage de femmes au C.A. | 36 % | 35 % |

Pour communiquer avec nous

clientexperience.dgia@desjardins.com

Sources : DGIA, MSCI, LSEG, au 31 décembre 2025

POUR INVESTISSEURS INSTITUTIONNELS CANADIENS SEULEMENT.

Cette information est strictement confidentielle et n'est destinée qu'aux investisseurs qualifiés en vertu du Règlement 45-106 sur les dispenses de prospectus.

Les rendements présentés sont ceux d'un composé de mandats investis dans des entreprises qui respectent les exigences de DGIA sur le plan ESG. Les contraintes d'investissement de certains mandats faisant partie du composé peuvent différer de celles du portefeuille représentatif. Les rendements sont présentés bruts des frais de gestion et des frais administratifs, mais nets des frais de transaction. Les rendements passés ne permettent pas nécessairement de prévoir les rendements futurs. Les autres informations présentées sont pour un portefeuille représentatif de la stratégie. Ces informations sont offertes à titre informatif seulement et sont sujettes à changement selon les conditions du marché ou toute autre conjoncture. 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. La marque Desjardins est une marque de commerce de la Fédération des caisses Desjardins du Québec utilisée sous licence.