

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

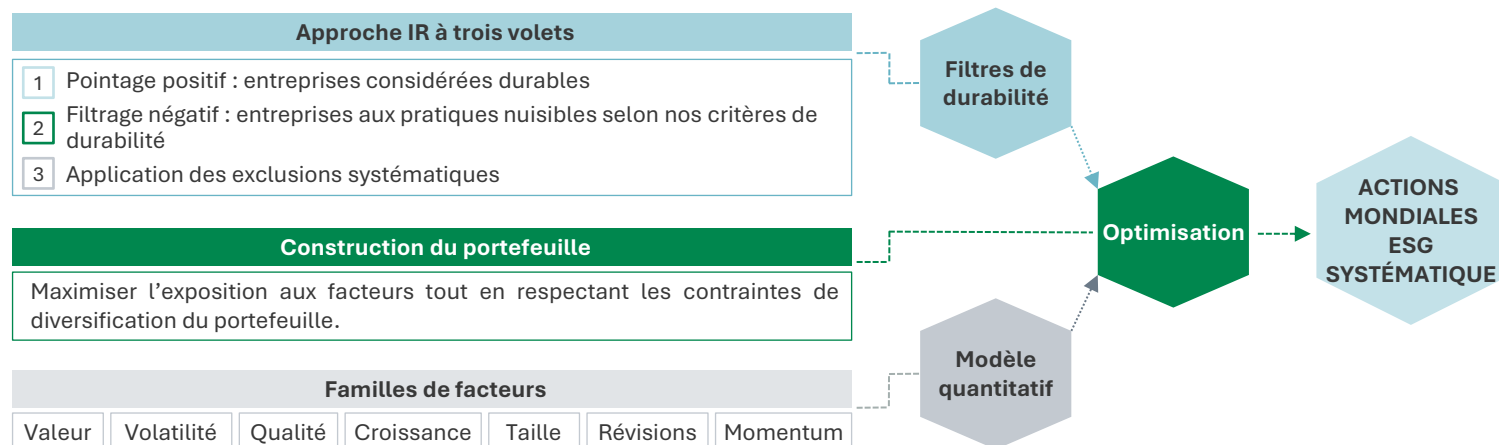
242 M\$

 Actifs sous gestion
dans la stratégie

26 février 2021

 Création du fonds
institutionnel

242 M\$

 Actifs sous gestion
dans le Fonds


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	2017
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.

POUR INVESTISSEURS INSTITUTIONNELS CANADIENS SEULEMENT (VOIR NOTES À LA DERNIÈRE PAGE)

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.