

# Notice ESG Fonds Equity Switzerland

## A. Objectif durable

Dans sa démarche, la BCVs entend créer un portefeuille présentant, en moyenne, une concordance ESG (environnement, social et gouvernance) supérieure à celle de l'indice de référence du fonds, le SPI<sup>®</sup>, au niveau de chaque secteur dans lequel le fonds est investi.

## B. Approches durables retenues dans le processus d'investissement

Les approches durables retenues sont les suivantes :

### 1. Approche de l'exclusion ✘

Cette approche consiste à exclure délibérément certaines sociétés d'un portefeuille en raison d'activités ou de pratiques contraires à certaines normes ou valeurs ou en raison de certains risques<sup>1</sup>.

### 2. Approche du filtrage positif ✔

Avec cette approche, les sociétés présentant de bonnes références de durabilité sont sélectionnées sur la base de leurs notes. L'objectif est de créer un portefeuille présentant, en moyenne, une note ou une concordance ESG supérieure à celle de la référence, ou d'atteindre une note moyenne minimale<sup>1</sup>.

## C. Sélection des investissements

### 1. Approche de l'exclusion ✘

Les critères d'exclusion suivants sont appliqués :

- Exclusion selon la liste publiée par l'Association suisse pour des investissements responsables (ASIR)<sup>2</sup> ; Cette liste vise les sociétés ayant des activités en lien avec les mines antipersonnel, les armes à sous-munition, les armes chimiques et biologiques ainsi que les armes nucléaires (Non-NPT) (exclusions sectorielles) ainsi que les sociétés ayant une conduite des affaires ne respectant pas les bonnes pratiques (exclusion relative à la conduite)
- Exclusion des sociétés qui génèrent plus de 5% de leur chiffre d'affaires dans l'extraction de charbon.

### 2. Approche du filtrage positif ✔

- Pour les titres de l'indice SPI<sup>®</sup>, il est procédé à un filtrage positif au sein de chaque secteur, sur la base des données fournies par Refinitiv<sup>3</sup>. L'ensemble des titres de l'indice SPI<sup>®</sup> sont classés par quintile dans chaque secteur, en fonction de leur notation ESG. Les titres bénéficiant de la moins bonne note (5<sup>ème</sup> quintile) sont systématiquement sous-pondérés au profit des autres titres du même secteur. Dans le cadre de l'univers d'investissement en résultant, la BCVs sélectionne les titres selon sa propre méthodologie.

---

<sup>1</sup> [www.am-switzerland.ch](http://www.am-switzerland.ch)

<sup>2</sup> [www.svk-asir.ch](http://www.svk-asir.ch)

<sup>3</sup> [www.refinitiv.com](http://www.refinitiv.com)


## D. Allocation durable

Au minimum 70% du portefeuille du fonds sont investis dans des placements qui répondent à la stratégie de durabilité mise en œuvre par la BCVs, telle que décrite ci-dessus.

Poche	Approche ESG	Taille
Titres directs	Exclusion et filtrage positif	85.73%
Fonds de placement	Pas d'approche ESG	14.27%
Futures	Pas d'approche ESG	0.00%
Liquidités	Pas d'approche ESG	0.00%

Données au 30.09.2024

## E. Notation interne BCVs

Selon la méthodologie interne à la BCVs, le fonds bénéficie d'une notation  sur une échelle de 0 à 3 planètes bleues.

Des informations complémentaires sur la stratégie de durabilité mise en œuvre dans ce fonds peuvent être obtenues auprès de la BCVs.