

Les indicateurs de durabilité Morningstar : mode d'emploi

■ Intermédiaire ⌚ 3 minutes

1 Pourquoi intégrer ces indicateurs dans votre analyse ?

- Pour comparer rapidement le **degré de prise en compte des risques ESG** par les fonds et identifier ceux dont **la gestion est la plus engagée sur ces critères**
- Pour identifier **les fonds faiblement carbonés** et dont les investissements sont en ligne avec la transition bas carbone

2 Qui est Morningstar ?

- ✓ Un des principaux fournisseurs d'information et de recherche financière indépendante au monde
- ✓ S'appuie sur les données Sustainalytics, leader en matière de recherche ESG

3 2 types d'indicateurs de durabilité



L'indicateur "Globes de durabilité"

- Une notation qui permet d'évaluer la gestion des risques ESG d'un fonds d'investissement comparativement à ceux de sa catégorie
- Cette note s'appuie sur les scores ESG des entreprises du portefeuille et s'exprime sous la forme de 1 à 5 globes :
 - 1 Globe pour les fonds les plus exposés aux risques ESG (dans les 10% les moins bien notés)
 - 5 Globes pour les fonds les moins exposés (10% les mieux notés)

Méthodologie : Tous les fonds dont au moins 50% des sociétés en portefeuille disposent d'une note ESG fournie par Sustainalytics sont notés.



L'indicateur "Faible Risque Carbone"

- Signale les fonds qui présentent une exposition très faible aux risques liés à la transition bas carbone et une faible implication dans les secteurs fossiles
- Le fonds doit remplir 2 conditions sur une période de 12 mois :
 1. un score de risque carbone inférieur à 10
 2. une exposition aux énergies fossiles de moins de 7% des actifs du portefeuille

Méthodologie : le score est calculé à partir des scores de chaque entreprise présente dans le portefeuille du fonds, pondéré par leur poids dans ce portefeuille.

Chez Fortuneo, vous avez à disposition pour élaborer votre stratégie d'investissement :

- + 300 fonds** ayant une note de durabilité élevée (4 ou 5 Globes)
- + 700 fonds** ayant un "Faible Risque Carbone"

Les unités de compte présentent un risque de perte en capital.

