

Indicateur carbone

Empreinte carbone

Tonnes CO₂ éq./M€ d'EVIC

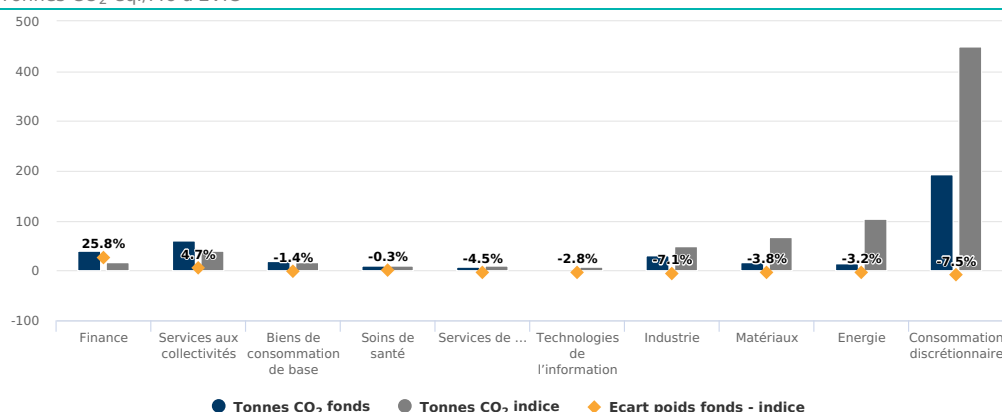
Source : MSCI - scopes 1, 2 et 3

Indice : 30% ICE BofA 1-3 Year Corporate + 70% ICE BofA BB-CCC 1-3 Year euro Developed Markets High Yield Constrained Index

Taux de couverture du fonds : 90.9%. Taux de couverture de l'indice : 89.6%

* éq : équivalent à l'ensemble des gaz à effet de serre convertis en CO₂ (scopes 1, 2 et 3)

Comparaison des contributions sectorielles en matière d'empreinte carbone

Tonnes CO₂ éq./M€ d'EVIC

5 principales contributions à l'empreinte carbone du fonds

ZF Europe Finance BV	13%
OPmobility SE	6%
Schaeffler AG	6%
Stellantis NV	4%
Air France-KLM SA	4%

Température implicite

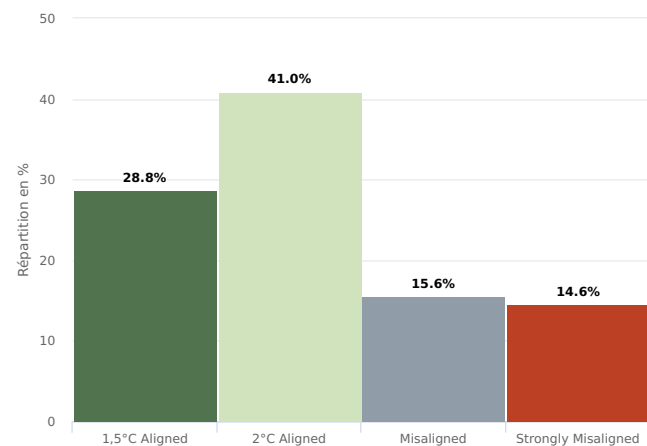
Température implicite (ITR)

Lazard Euro Short Duration High Yield SRI

2 °C

Répartition des ITR

En %



Source: MSCI

Températures les plus basses

TenneT Holding BV	1.5°C Aligned	1.3 °C
Grifols SA	1.5°C Aligned	1.3 °C
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	1.5°C Aligned	1.3 °C
Unicaja Banco SA	1.5°C Aligned	1.3 °C
Enel SpA	1.5°C Aligned	1.3 °C

Températures les plus élevées

INEOS Finance Plc	Strongly Misaligned	10 °C
Avis Budget Finance Plc	Strongly Misaligned	10 °C
Dometic Group AB	Strongly Misaligned	9.6 °C
Accor SA	Strongly Misaligned	8.8 °C
Arkema SA	Strongly Misaligned	8 °C

Méthodologie Empreinte Carbone

- La méthode de calcul de l'empreinte carbone d'un portefeuille est une moyenne pondérée des émissions de gaz à effets de serre divisée par l'EVIC de chaque émetteur.
- L'évaluation de l'empreinte carbone prend en compte les scopes 1 et 2 et 3 des émissions de gaz à effet de serre (GES).
- Nous obtenons ainsi la formule suivante :

$$\text{Empreinte carbone d'un portefeuille} = \sum \left[\left(\frac{\text{Emissions (scope 1 + 2 + 3)}}{\text{EVIC}} \right) \text{ de chaque titre} \times \text{poids de chaque titre} \right]$$

- L'approche fondamentale de Lazard Frères Gestion axée sur la sélection de titres engendre des écarts d'expositions sectorielles entre les fonds et leurs indices de référence.