

L'Auxiliaire Vie

Rapport Article 29
de la loi n°2019-1147 du 8 novembre 2019
relative à l'énergie et au climat

Lyon, le 21/06/2024

Direction financière

Revue par : Direction générale

Date de validation : 21/06/2024



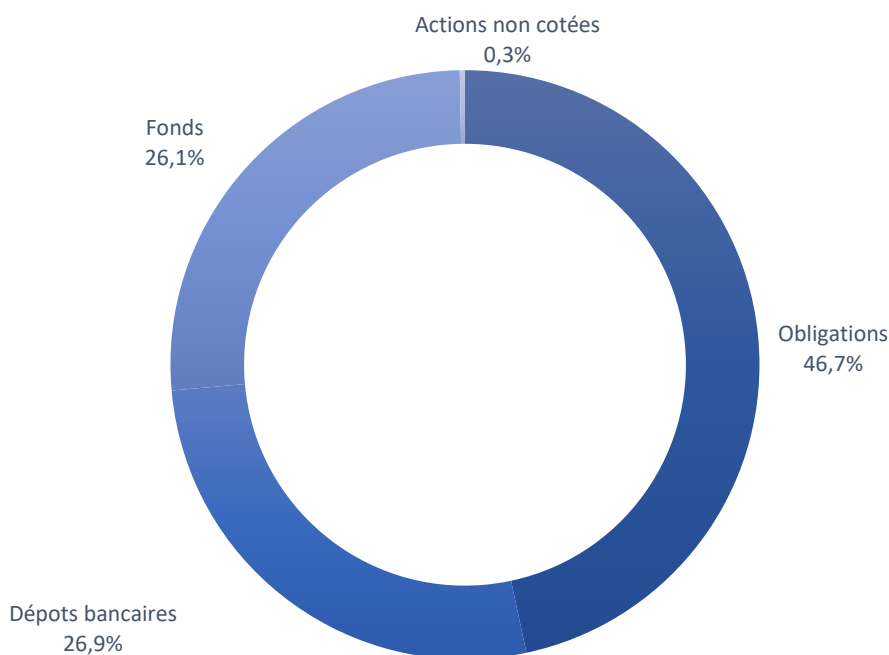
1. Contexte

Conformément à l'article 29 de la Loi Energie climat, L'Auxiliaire Vie en tant qu'assureur vie établit le présent rapport portant sur la prise en compte des facteurs de durabilité dans sa politique d'investissement.

Ce rapport annuel traite de la mise en œuvre de la politique relative à la prise en compte des critères ESG dans la stratégie d'investissement. Il est établi sur la base d'une situation au 31 décembre 2023.

2. Présentation de l'information

La présente information couvre l'ensemble des actifs gérés par L'Auxiliaire Vie. Le total des placements de L'Auxiliaire Vie s'élève à 9,1 M€ exprimé en valorisation Solvabilité 2 au 31/12/2023, répartis de la manière suivante :





3. Démarche générale de L'Auxiliaire Vie

3.1 Présentation résumée de la démarche générale de l'entité sur la prise en compte de critères environnementaux, sociaux et de qualité de gouvernance, et notamment dans la politique et stratégie d'investissement

La Direction Financière de L'Auxiliaire gère les actifs mobiliers de la Mutuelle Vie en fonction de la Politique de gestion du risque d'investissement arrêtée par le conseil d'administration de L'Auxiliaire Vie et des décisions prises par le Comité Financier.

En 2023, L'Auxiliaire Vie a intégré le risque en matière de durabilité dans sa politique détaillée de gestion du risque d'investissement. Pour suivre ce risque, L'Auxiliaire Vie a souscrit à Sequantis Transition Monitor. Ce contrat lui permet d'avoir accès à des données extra-financières fournies par Carbone 4 et Sustainalytics. L'Auxiliaire Vie a également collecté des données extra-financières sur les fonds d'investissement au travers d'un questionnaire de place, celui de l'AF2i.

3.2 Contenu, fréquence et moyens utilisés par l'entité pour informer les souscripteurs, affiliés, cotisants, allocataires ou clients sur les critères relatifs aux objectifs environnementaux, sociaux et de qualité de gouvernance pris en compte dans la politique et la stratégie d'investissement

Le présent rapport « article 29 » sera produit à fréquence annuelle, et porte l'information destinée aux sociétaires ou au public concernant les critères relatifs aux objectifs environnementaux, sociaux et de qualité de gouvernance pris en compte dans la politique et la stratégie d'investissement.

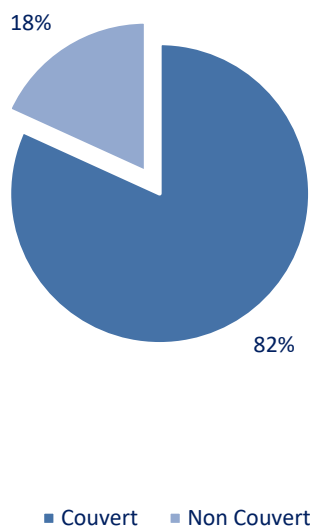
Parmi les données extra financières fournies par Sequantis, un certain nombre sont suivis régulièrement et présentés en Comité Financier tels que le taux de couverture de ces informations sur l'ensemble du portefeuille, l'empreinte carbone, la notation ESG et la température du portefeuille.

Compte tenu du taux de couverture des données extra financières de L'Auxiliaire Vie, nous suivons ces données principalement sur le portefeuille obligataire (incluant les dépôts bancaires) pour une meilleure cohérence de l'information. La partie non couverte du portefeuille fait l'objet d'estimations sectorielles pour pouvoir inclure ces données dans nos rapports.

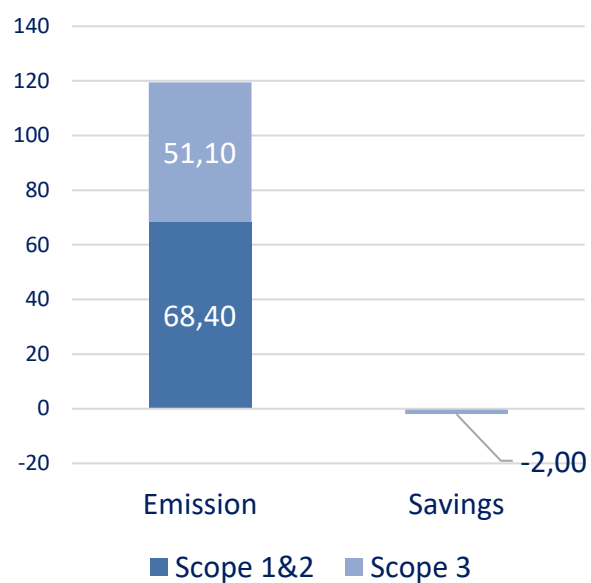




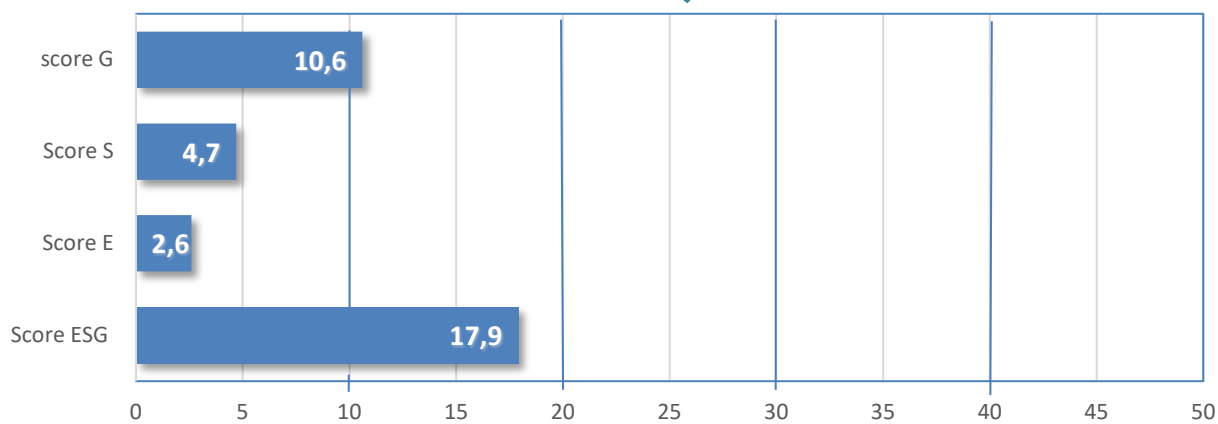
COUVERTURE DES DONNÉES ESG



Empreinte carbone et Savings (en tonne équivalent CO²/M€)



NOTATION DU RISQUE ESG





3.3 Liste des produits financiers mentionnés en vertu de l'article 8 et de l'article 9 du règlement (UE) 2019/2088 du Parlement européen et du Conseil du 27 novembre 2019, et la part globale, en pourcentage, des encours sous gestion prenant en compte des critères environnementaux, sociaux et de qualité de gouvernance dans le montant total des encours gérés par l'entité

Seuls les fonds d'investissements sont concernés par la classification SFDR en article 8 et 9.

Placements	Montant en k€	Pourcentage
Fonds d'investissements Article 6	1 095 k€	12,1%
Fonds d'investissements Article 8	1 236 k€	13,6%
Fonds d'investissements Article 9	38 k€	0,4%
Total Fonds d'investissements	2 369 k€	26,1%

Liste des fonds Article 9 SFDR

Nom du Fonds	Montant en k€
Eiffel Energy Transition 3	38 k€

Liste des fonds Article 8 SFDR

Nom du Fonds	Montant en k€
Bati Actions Investissement	775 k€
Dynasty Global Convertible	208 k€
Zencap Rebond Tricolore	157 k€
EMZ 10	96 k€

3.4 Prise en compte des critères environnementaux, sociaux et de qualité de gouvernance dans le processus de prise de décision pour l'attribution de nouveaux mandats de gestion.

L'Auxiliaire Vie ne confie pas de mandats à des sociétés de gestion.

3.5 Adhésion de l'entité, ou de certains produits financiers, à une charte, un code, une initiative ou obtention d'un label sur la prise en compte de critères environnementaux, sociaux et de qualité de gouvernance

Actuellement L'Auxiliaire Vie n'est ni signataire, ni adhérente à des initiatives en lien avec l'ESG.

