

RAPPORT ANNUEL ETABLI AU TITRE DE L'ARTICLE 29 DE LA LOI ENERGIE CLIMAT
EXERCICE CLOS LE 31 DECEMBRE 2023

Le décret d'application de l'article 29 de la loi n°2019-1147 du 8 novembre 2019 dite Loi Energie Climat (LEC) a établi le cadre réglementaire applicable en matière de transparence des acteurs du marché, autour de leurs pratiques extra-financières, et la nécessité de publier un rapport documentaire à l'intention des investisseurs.

Ce rapport est établi conformément aux dispositions prévues à l'alinéa V de l'article D.533-16-1 du Code monétaire et financier pour les organismes ayant moins de cinq cents millions d'Euros de total d'encours sous gestion.

Il est accessible sur le site de la société de gestion www.keyquant.com et mis à disposition sur le site de l'Agence de l'Environnement et de la Maîtrise de l'Energie (ADEME) – www.ademe.fr

Il est également tenu à disposition de l'Autorité des marchés financiers (AMF).

Démarche de KeyQuant sur la prise en compte des critères environnementaux, sociaux et de qualité de gouvernance (« ESG »)

KeyQuant est une société de gestion spécialisée dans la conception et la mise en œuvre de stratégies de *trading* systématiques basées sur des analyses quantitatives de suivi de tendances et un contrôle des risques robuste à destination exclusive d'investisseurs professionnels.

Les portefeuilles gérés conformément au programme propriétaire phare de la société de gestion, Key Trends, traitent un univers de soixante-quinze contrats à terme sur treize marchés réglementés de neuf pays différents. Les actifs sous-jacents de ces contrats à terme sont les taux d'intérêt à court et à long terme, les devises, les actions, les indices et les matières premières.

Le programme Key Trends vise à engendrer des gains en capital dans la limite d'une tolérance prédéfinie à un niveau convenu de risque de marché, en tirant parti des mouvements directionnels que connaissent les prix des actifs sous-jacents et les *spreads* sur un horizon à court et moyen terme.

La société de gestion structure sa définition des risques en matière de durabilité autour de six thèmes principaux :

1. Risques réputationnels
2. Risques de corruption et de blanchiment de capitaux
3. Risques de responsabilité liés au changement climatique
4. Risques physiques liés au changement climatique
5. Risques de transition liés au changement climatique
6. Risques liés à la biodiversité

Dans ce cadre, le risque de durabilité constitue l'une des composantes du référentiel global de gestion des risques adopté par la société de gestion.

Néanmoins, les risques liés au changement climatique et à la biodiversité ne revêtent pas un caractère significatif et pertinent sur l'horizon temporel d'intervention de KeyQuant sur les marchés financiers. Ce faisant, la société de gestion n'est pas en mesure de prendre spécifiquement en compte, lors de sa prise de décisions d'investissement, les potentiels impacts négatifs de ces dernières sur les risques liés au changement climatique et à la biodiversité.

KeyQuant

La stratégie est conçue pour être diversifiée et ne pas détenir de positions concentrées, ce qui atténue le risque qu'un événement ou une condition ESG spécifique ait un impact négatif significatif sur la valeur globale des investissements.

Les investissements ne tiennent pas compte des critères de l'Union Européenne en faveur des activités économiques respectueuses de l'environnement car KeyQuant met en œuvre une stratégie d'investissement qu'elle considère incompatible avec une analyse poste par poste de potentielles incidences négatives sur le changement climatique et la biodiversité et parce que le large éventail des classes d'actifs traitées rend complexe, voire matériellement inexacte, la quantification de telles potentielles incidences.

Enfin, les investissements réalisés ne comportent pas de droit de vote de telle façon qu'une prise de position actionnariale sur des critères environnementaux, sociaux et de qualité de gouvernance n'est pas à l'ordre du jour.

Contenu, fréquence et moyens utilisés pour informer les investisseurs sur les critères relatifs aux objectifs environnementaux, sociaux et de qualité de gouvernance

Le site internet de la société de gestion, www.keyquant.com, constitue le mode d'information privilégié par KeyQuant. Néanmoins, il est à noter que compte tenu de la typologie des investisseurs de la société de gestion, l'accès à l'information peut être restreint et soumis à la délivrance d'identifiants de connexion propres.

CONTENU	FREQUENCE	MOYENS
Information sur le règlement « Disclosure » ou SFDR	Annuelle	Site internet de KeyQuant
Rapport Art.29 LEC	Annuelle	Site internet de KeyQuant
Information précontractuelle relative aux FIAs	Antérieurement à toute souscription et lors de toute mise à jour	Transmission par voie électronique
Rapport annuel des FIAs	Annuelle	Transmission par voie électronique
Reporting	Mensuelle	Site internet de KeyQuant

Liste de produits financiers en vertu de l'article 8 et de l'article 9 du Règlement (UE) 2019/2088, dit « Règlement Disclosure ou SFDR » adopté par le Parlement européen et le Conseil de l'Union Européenne le 27 novembre 2019, et 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

Les fonds d'investissement alternatifs gérés en direct par KeyQuant entrent dans le champ de l'article 6 du règlement (UE) 2019/2088, dit « Règlement Disclosure ou SFDR » adopté par le Parlement européen et le Conseil de l'Union Européenne le 27 novembre 2019 et portant sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers. L'article 6 du règlement (UE) 2019/2088, dit « Règlement Disclosure ou SFDR » concerne les produits financiers qui ne font pas la promotion des caractéristiques environnementales et/ou sociales, qui n'ont pas un objectif d'investissement durable et ne répondent pas à la définition des articles 8 et 9.

Adhésion à une charte, un code, une initiative ou obtention d'un label sur la prise en compte des critères environnementaux, sociaux et de qualité de gouvernance

KeyQuant est signataire depuis janvier 2020 des Principes pour l'Investissement Responsable soutenus par l'Organisation des Nations Unies (UNPRI).

Les Principes pour l'Investissement Responsable sont le principal moteur de l'investissement responsable. Ils favorisent :

- une meilleure compréhension des implications de l'intégration dans les processus d'investissement des facteurs environnementaux, sociaux et de qualité de gouvernance
- l'intégration par le réseau international des investisseurs signataires des facteurs environnementaux, sociaux et de qualité de gouvernance
- l'utilisation de l'investissement responsable pour améliorer les rendements et mieux gérer les risques
- l'intérêt à long terme de ses signataires, des marchés financiers et des économies dans lesquels ils opèrent et, plus largement, de l'environnement et de la société dans son ensemble

Paris, le 10 juin 2024