

STRUCTURE DES INFORMATIONS DE DURABILITE DU RAPPORT ANNUEL CONFORMEMENT AUX DISPOSITIONS PREVUES AU V DE L'ARTICLE D.533-16-1 DU CODE MONETAIRE ET FINANCIER POUR LES ORGANISMES AYANT MOINS DE 500 MILLIONS D'EUROS DE TOTAL DE BILAN OU D'ENCOURS

Selwood Asset Management France est une société de gestion régulée AMF depuis 02.2021. Nous gérons 426M€ au 31.12.2024. Selwood AM France France est spécialisé sur les dérivés de crédits et apporte des solutions institutionnelles dans l'univers du Long Only. Nos clients sont pour la plupart des institutionnels Français et nous développons notre offre de plus en plus en Europe.

Nous avons un fonds en délégation (**Auris Investment Grade**) par Auris Gestion qui est article 8 limité au prospectus (AUM de 45M€ au 30.06.2024). L'information sur la démarche générale et la prise en compte des critères environnement, sociaux et de gouvernance est disponible auprès de Auris Gestion. <https://www.aurisgestion.com/>

Nous avons un nouveau fonds **Selwood ESG Crédit** avec Waystone qui est article 8 (AUM de 21M€ au 30.06.2024). L'information sur la démarche générale et la prise en compte des critères environnement, sociaux et de gouvernance est disponible auprès de Auris Gestion. <https://www.aurisgestion.com/>

A. Démarche générale de l'entité sur la prise en compte des critères environnementaux, sociaux et de qualité de gouvernance

A.1. Résumé de la démarche

- Nous n'avons pas de fonds dont la SGP est gestionnaire en titre qui soit article 8 (ou 9). Cependant nous avons mis en place une politique ESG qui est disponible sur notre site Web dans le cadre du lancement prochain d'un fonds Article 8. Cette dernière est disponible sous : <https://selwoodam.fr/>.
- Sur notre fonds en délégation, Auris Investment Grade (SFDR Article 8 – Limité au prospectus), on s'impose un minimum de 20% de notre exposition synthétique crédit (iTraxx) sur le nouvel indice iTraxx MSCI ESG Screened Index qui est soumis a un screening ESG de la part de MSCI (voir iTraxx MSCI ESG Screened Europe Index Rules sur le site de S&P Global) avec trois filtres (i) *Value based Screened*, i.e exclusion de certains secteurs (ii) ESG Rating de MSCI \geq BBB and (iii) Controverse Screening. Le produit ne prend pas en compte les PAI. Toutes les informations sur le fonds sont disponibles auprès de Auris sur : <https://www.aurisgestion.com/fr-fr/auris-investment-grade-i-eur>
- Sur notre fonds Selwood ESG Crédit, en plus de traiter l'indice iTraxx ESG Credit (ou répliquer) nous avons mis en place une gestion active de notre cash (80% des AUM du fonds) en Green Bonds émis par des SSA's ou govies core en Europe. Cette allocation vient directement financier des initiatives environnementales avec un impact direct et mesurable. Nous envisageons de répliquer la méthode sur d'autres fond de notre gamme.
- Enfin, dans le cadre de la signature des PRI de notre groupe nous avons mis en place une politique d'exclusion sur nos instruments cash crédits (hors synthétique) qui est décrite dans notre politique ESG disponible sur notre site web.

A.2. Contenu, fréquence et moyens utilisés pour informer les souscripteurs, affiliés, cotisants, allocataires ou clients sur les critères relatifs aux objectifs ESG pris en compte dans la politique et la stratégie d'investissement

- Non applicable sur nos fonds Article 6
- Sur le fonds **Selwood ESG Crédit**, plusieurs rapports sont disponibles pour nos clients sur la stratégie d'investissement et l'impact de nos allocations. Nous utilisons pour cela les données fournies par SP Global Trucost.
 1. Du fait de notre allocation Green Bonds (~80% des AUM) – **un rapport d'impact annuel** est fourni par SP Global sur le fonds (« Green Bonds Reports – Climate Related Portfolio Assessment in line with TCFD Recommandations »).
 2. Un **rapport SFDR annuel** est aussi fourni par SP Global sur le fonds Selwood ESG Credit.
 3. Enfin - **toutes les semaines** un rapport détaillé est envoyé aux clients (*Weekly report*), rapport qui permet le suivi de certains PAI, Green Bonds (SDG's et Avoided Emissions) et Empreinte Carbone du portefeuille en agrégeant les données de SP Global. Ce rapport est disponible sur demande auprès de paris@selwoodam.com.

A.3. 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 ESG ainsi qu'une description sommaire de ceux-ci

Non applicable pour l'instant. Il est envisagé de faire passer le fonds Selwood ESG Crédit sous le label *Luxflag ESG label* mais on attendra aussi un peu plus de visibilité sur la réglementation qui ne cesse d'évoluer.

Les entités assujetties aux obligations de publication de l'article 29 de la loi 2019-1147 relative à l'énergie et au climat fournissent les informations prévues au a), b), d) et e) du 1° du III de l'article D. 533-16-1 du code monétaire et financier

Voir les informations sur le fonds Auris Investment Grade sur :
<https://www.aurisgestion.com/fr-fr/auris-investment-grade-i-eur>
[DIC, Rapport Annuel, Politique ESG, Prospectus, Rapport Semestriel]

Pour le fonds Selwood ESG Credit – les informations sont disponibles sur :
<https://www.montlakeucits.com/subfund/selwood-esg-credit-ucits-fund/>
Ainsi que <https://selwoodam.fr/>

B. Liste des produits financiers mentionnés en vertu de l'article 8 et 9 du Règlement (UE) 2019/2088 du Parlement Européen et du Conseil du 27 novembre 2019 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (SFDR)

1. Liste des produits financiers 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 par l'entité.

Nous avons 2 fonds Article 8 en délégation (66M€ sur un total de 426M€ ; i.e. **~15% de nos actifs**). Les informations sur ce fonds sont disponibles auprès de Auris Gestion (Management Compagny) et le nom du fonds est Auris Investment Grade. (<https://www.aurisgestion.com/>). L'autre fonds, Selwood ESG Crédit, est disponible auprès de Waystone sur <https://www.montlakeucits.com/subfund/selwood-esg-credit-ucits-fund/>

2. Les entités assujetties aux obligations de publication de l'article 29 de la loi relative à l'énergie et au climat fournissent les informations prévues au c) du 1° du III de l'article D. 533-16-1 du code monétaire et financier

Voir les informations sur le fonds **Auris Investment Grade** sur :

<https://www.aurisgestion.com/fr-fr/auris-investment-grade-i-eur>

[DIC, Rapport Annuel, Politique ESG, Prospectus, Rapport Semestriel]

Pour le fonds Selwood ESG Credit – les informations sont disponibles sur :

<https://www.montlakeucits.com/subfund/selwood-esg-credit-ucits-fund/>

Ainsi que <https://selwoodam.fr/>

Pour toute information complémentaire ; merci de contacter la Société de Gestion Selwood AM France dont le contact est le suivant :

Selwood Asset Management (France) SAS

40 rue du colisee – 75008 – Paris

FR Desk : +33 1 86 47 60 07

<https://www.selwoodam.fr/>