



Rcube Asset Management SAS
9 Avenue Franklin Roosevelt
Paris, France 75008
Phone : +33 1 45 64 31 03
Email : cyril.castelli@rcube.com

RAPPORT 2023

Article 29 de la Loi Énergie Climat

Ce rapport répond aux exigences de l'article 29 de la loi n° 2019-1147 du 8 novembre 2019 et de son décret d'application n° 2021-663 publié le 27 mai 2021

DÉMARCHE GÉNÉRALE DE RCUBE ASSET MANAGEMENT SUR LA PRISE EN COMPTE DES CRITÈRES ENVIRONNEMENTAUX, SOCIAUX ET DE QUALITÉ DE GOUVERNANCE (« ESG »), ET NOTAMMENT DANS LA POLITIQUE ET STRATÉGIE D'INVESTISSEMENT

RCUBE ASSET MANAGEMENT est une société de gestion agréée en France par l'Autorité des marchés financiers et enregistrée par la *Commodity Futures Trading Commission* (CFTC) et membre de la *National Futures Association* (NFA) aux États-Unis en qualité de *Commodity Trading Advisor* (CTA) et *Commodity Pool Operator* (CPO).

RCUBE ASSET MANAGEMENT est une plateforme Multi Managers (MMP) dédiée à la gestion d'actifs en France et à l'international proposant un modèle favorisant le maintien de compétences en France.

Elle poursuit l'objectif de porter à maturité des projets entrepreneuriaux de gestions d'actifs innovants, en particulier dans le domaine de la gestion alternative liquide.

RCUBE ASSET MANAGEMENT propose des solutions d'hébergement et de gestion de véhicules d'investissement (gestion collective ou mandats), de structuration de produits d'investissement autour du *seeding* de fonds et de distribution en France et à l'étranger des produits d'investissements éligibles aux programmes d'accélération de la société.

RCUBE ASSET MANAGEMENT met à la disposition des gérants sélectionnés des outils de gestion et de contrôle des risques, son dispositif de contrôle interne, son Middle Office, son infrastructure et systèmes informatiques, ainsi qu'un support opérationnel et commercial. Cette approche permet aux gérants de se concentrer pleinement sur l'acte de gestion et la recherche.

Ce dispositif permet ainsi à RCUBE ASSET MANAGEMENT de proposer aux investisseurs institutionnels français et clients professionnels, des fonds multi-stratégies sur son modèle de MMP. RCUBE ASSET MANAGEMENT porte la conviction que la

diversification des moteurs de performances des fonds multi-stratégies renforce très significativement les rendements ajustés des risques et qu'il répond à un besoin important des investisseurs français et européens qui n'ont pas accès aux fonds des Multi Manager Platforms anglo-saxons. En se concentrant sur des projets à faible capacité, RCUBE ASSET MANAGEMENT construit un alpha unique car très différent de la concurrence et rend viable le lancement de stratégies qui n'auraient pas la capacité de gérer des actifs suffisamment importants pour justifier la création d'une société de gestion.

Elle investit essentiellement selon des stratégies de gestion alternative liquide (arbitrage, relative value, trading court terme, arbitrage de volatilité, long/short, CTA, ...) par utilisation d'instruments financiers variés principalement des produits dérivés négociés sur des marchés réglementés, mais également des actions et titres de créances cotées, etc... Les investissements se font par la prise de positions longues et/ou courtes sur des horizons d'investissement de fréquences variées, et souvent selon des stratégies et/ou techniques quantitatives.

De ce fait, de manière générale, aucun critère ESG n'intervient dans le processus de sélection des instruments ou titres sur lesquels les Gérants de RCUBE ASSET MANAGEMENT vont envoyer des ordres pour exécution, et l'impact négatif des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité n'est pas, à ce stade, pris en compte.

Pour autant, même si les leviers d'investissement responsables les plus usuels ne sont pas applicables à la plupart de ses stratégies d'investissement, RCUBE ASSET MANAGEMENT a créé et gère depuis 2021 un OPCVM classé article 8 de SFDR – *Sustainable Financial Disclosure Regulation* (GBI GOOD GOVERNANCE UCITS) en partenariat avec Green Blue Invest, société commerciale de droit suisse exerçant une activité de conseil en matière d'investissement durable, fournisseur d'analyse extra financière.

Par conséquent, la politique et stratégie d'investissement ESG de RCUBE ASSET MANAGEMENT s'appuient sur une [Politique de critères ESG](#), une [Politique de gestion des risques en matière de durabilité](#) et une [Politique de prise en compte des principales incidences négatives en matière de durabilité](#).

CONTENU, FRÉQUENCE ET MOYENS UTILISÉS POUR INFORMER LES SOUSCRIPTEURS SUR LES CRITÈRES ESG

Pour informer ses clients sur sa politique et sa stratégie d'investissement responsable, RCUBE ASSET MANAGEMENT utilise essentiellement son site internet www.rcube.com


CONTENU	FRÉQUENCE	MOYENS
Factsheet / reporting	Mensuelle	Site internet RCUBE ASSET MANAGEMENT
Rapport d'impact ESG sur 14 métriques	Annuelle	Site internet RCUBE ASSET MANAGEMENT
Politique de critères ESG	Annuelle	Site internet RCUBE ASSET MANAGEMENT
Prise en compte des principales incidences négatives en matière de durabilité	Annuelle	Site internet RCUBE ASSET MANAGEMENT
Prise en compte des risques en matière de durabilité	Annuelle	Site internet RCUBE ASSET MANAGEMENT
Politique d'exclusion	Annuelle	Disponible sur simple demande
Information précontractuelle (DIC, prospectus, Annexe Article 8 de SFDR)	Avant souscription et mise à jour annuelle	Remise lors de la souscription par le Distributeur Site internet RCUBE ASSET MANAGEMENT
Reporting périodique de SFDR (Annexe Article 8)	Annuelle	Site internet RCUBE ASSET MANAGEMENT
Rapport annuel du fonds	Annuelle	Disponible sur simple demande

LISTE DES PRODUITS FINANCIERS EN VERTU DE L'ART. 8 ET DE L'ART. 9 DU RÈGLEMENT SFDR

Au 31 décembre 2023, 1 seul OPCVM (GBI GOOD GOVERNANCE UCITS) de RCUBE ASSET MANAGEMENT représentant 1.37% du total des actifs sous gestion, intègrait et faisait la promotion de critères ESG (article 8 du règlement SFDR).

ADHÉSION À UN CODE, UNE INITIATIVE, OU OBTENTION D'UN LABEL

RCUBE ASSET MANAGEMENT est membre de l'ICGN (*International Corporate Governance Network*) depuis mai 2020. Elle partage les convictions et les valeurs de cette initiative internationale et s'engage à en appliquer les principes de bonne gouvernance, en tenant compte de ses contraintes de taille et d'activités.

INITIATIVE	DATE D'ADHÉSION	PRINCIPALES MISSIONS
 ICGN International Corporate Governance Network	Mai 2020	<ul style="list-style-type: none">- Promouvoir la gouvernance d'entreprise, cela comprend la sensibilisation à l'importance de la gouvernance d'entreprise pour la performance et la durabilité des entreprises, ainsi que la confiance des investisseurs ;- Faciliter l'échange de bonnes pratiques entre ses membres, principalement des investisseurs institutionnels, des gestionnaires d'actifs, des entreprises ;- Développer des normes et des lignes directrices afin d'améliorer les pratiques de gouvernance ;- S'engager auprès des parties prenantes ;- Mener des recherches dans le domaine de la gouvernance d'entreprise.

Rcube Asset Management SAS

Date : 27 Juin 2024