

Informations réglementaires SFDR et Taxonomie

Le fonds Autofocus Transition Climat Février 2023 intègre des caractéristiques environnementales et/ou sociales dans sa stratégie d'investissement au sens de la réglementation SFDR, à savoir :

- (i) la prise en compte de critères ESG dans la sélection des actifs financiers. Chaque émetteur est analysé sur un ensemble de critères environnementaux (ex. émissions de CO₂) sociaux (ex. taux de fréquence des accidents) et de gouvernance (ex. éthique des affaires) ;
- (ii) la prise en compte de critères ESG dans la méthodologie de construction de l'Indice de référence utilisé dans le cadre de la formule. Différents filtres d'exclusion ESG sont appliqués afin d'exclure les émetteurs les plus controversés et les émetteurs ayant une notation ESG insuffisante.

L'indice de référence retenu, dans la mesure où il est construit selon une approche ESG, est adapté aux caractéristiques environnementales et sociales poursuivies par le FCP. Nous attirons l'attention des porteurs sur le fait que la méthodologie extra-financière mise en œuvre au niveau de l'Indice de référence ne permet pas de mesurer l'impact de l'actif de hors bilan sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales poursuivies par le FCP.

Le poids des investissements effectués dans des activités économiques considérées comme durables sur le plan environnemental au sens du règlement Taxonomie 2020/852 est calculé en pondérant par la dernière valorisation retenue pour la valorisation du FCP, les actifs alignés à la taxonomie européenne. Ce FCP sera exposé entre 0% et 5% de son portefeuille dans des activités alignées avec la Taxonomie Européenne en matière d'atténuation du changement climatique et/ou d'adaptation au changement climatique. Ce calcul est réalisé à partir des composantes de l'Indice de référence.

Le principe consistant à "ne pas causer de préjudice important" s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.