

**Informations précontractuelles pour les produits financiers visés à l’Article 8,
paragraphe 1, 2 et 2bis du règlement (UE) 2019/2088 et à l’Article 6, premier alinéa,
du règlement (UE) 2020/852**

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu’il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier investit appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

Dénomination du produit : Autofocus Ambition Planète Juillet 2024

Identifiant d'entité juridique : 969500INR1WF0UA1PN08

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

La **taxinomie de l’UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d’activités économiques durables sur le plan environnemental. Ce règlement ne dresse pas de liste d’activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

☒ ☐ **Oui**

☐ ☒ **Non**

☐ Il réalisera un minimum d’investissements durables ayant un objectif environnemental : «__»%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l’UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l’UE

☐ Il réalisera un minimum d’investissements durables ayant un objectif social : __%

☒ Il **promeut des caractéristiques environnementales et sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il contiendra une proportion minimale de 40 % d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l’UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l’UE

☐ ayant un objectif social

☐ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d’investissements durables**



Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Quelles caractéristiques environnementales et/ou sociales sont promues par ce produit financier ?

Le fonds intègre des caractéristiques environnementales et sociales dans sa stratégie d'investissement à travers la réplique physique totale de l'indice Solactive Transatlantique Planète Index 5 % AR.

Cet indice est un indice de marché actions publié par Solactive. L'indice est défini sur la base d'un univers de valeurs listées en France, Allemagne et Etats-Unis de large et moyenne capitalisation dans lequel sont sélectionnées les 80 entreprises affichant les meilleures performances en termes de décarbonation. L'indice sélectionne donc entre autres les entreprises dont les stratégies de décarbonation permettent, dans leur ensemble, la limitation de la hausse des températures à 1.5°C à horizon 2100 et ce conformément aux engagements entérinés par l'Accord de Paris.

Ainsi, l'indice Solactive Transatlantique Planète index 5 % AR vise principalement à réduire son intensité carbone de 7 % en rythme annuel et de réduire cette même intensité de 50 % par rapport à son indice parent.

● *Quels sont les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?*

1/ Intensité carbone Scopes 1 et 2 (tonnes de CO₂ émises/Millions d'€ de Chiffre d'Affaires).

Les émissions de scope 1 comprennent l'ensemble des émissions de gaz à effet de serre directement émises par la société et induites de ses activités de production de biens et services.

Les émissions de scope 2 comprennent l'ensemble des émissions de gaz à effet de serre inhérentes à la production de l'électricité consommée par la société pour la réalisation de ses activités.

● *Quels sont les objectifs des investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre et comment les investissements effectués contribuent-ils à ces objectifs ?*

Le fonds investira à hauteur de 40 % de son actif dans des entités dont la trajectoire climatique est certifiée "1,5°C" ou "bien au-dessous 2°C" par l'initiative Science Based Targets.

● *Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre ne causent-ils pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?*

Dans le cadre des investissements réalisés en direct par le fonds, l'algorithme de sélection évalue l'absence de préjudice important à aucun de ces objectifs d'investissement durable ("Do Not Significant Harm" ou "DNSH"), tel que ce principe est défini par le Règlement (UE) 2019/2088 (Règlement SFDR), via la mesure des Principales Incidences Négatives ("PAI"). Tout investissement qui ne respecte pas le principe "DNSH", n'est pas considéré comme un investissement durable.

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

Les principales incidences négatives ("PAI"), telles que définies par le Règlement Délégué (UE) 2022/1288, sont prises en compte lors de l'application de listes d'exclusion réalisées lors de la sélection des constituants de l'indice que le fonds réplique physiquement.

- Pacte Mondial des Nations Unies (PAI n°10) : Exclusion des sociétés qui violent les droits de l'Homme (PAI n°10).

- Politique Pétrole et Gaz (PAI n°4) : Exclusion des sociétés dont la production d'énergies fossiles représente plus de 10 % de la production annuelle d'énergies fossiles ainsi que les projets dédiés aux énergies fossiles non conventionnelles.

- Politique Charbon (PAI n°4) : Exclusion des sociétés qui :
(i) réalisent plus de 0 % de leur chiffre d'affaires dans le charbon (mines et centrales) ou qui

produisent plus de 0 % de leur énergie à partir de charbon
(ii) sont impliquées dans l'exploitation des énergies fossiles non conventionnelles
(iii) réalisent plus de 50 % de leur production électrique à partir des énergies fossiles.

- Armes controversées (PAI n°14) : exclusion des sociétés impliquées dans la fabrication, le commerce ou le stockage de mines antipersonnel et/ou des armes à sous-munitions et/ou des armes bactériologiques et chimiques.

- Prise en compte des émissions de GES (PAI n°1), de l'empreinte carbone (PAI n°2), et de l'intensité de GES des sociétés (PAI n°3).

De plus, les autres PAI sont pris en compte dans la méthodologie de notation extra financière appliquée pour la sélection des constituants de l'indice. Cette méthodologie repose sur le pilier Environnement

- Environnement : prise en compte des impacts des activités sur la biodiversité (PAI n°7), des rejets dans l'eau (PAI n°8) et des rejets de déchets (PAI n°9), de la part de consommation et de production d'énergie non renouvelable (PAI n°5), et de l'intensité de consommation d'énergie (PAI n°6).

- Dans quelle mesure les investissements durables sont-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations Unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

L'algorithme de sélection des constituants de l'indice que le fonds réplique physiquement exclut les entreprises qui ne respectent pas les principes du Pacte Mondial des Nations Unies ainsi que les Principes directeurs de l'OCDE.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à "ne pas causer de préjudice important" en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE. Elle s'accompagne de critères propres de l'UE.

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.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Ce produit financier prend-il en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité?

☒ Oui Les principales incidences négatives sont prises en compte par l'algorithme de sélection des constituants de l'indice que le fonds réplique physiquement.

Cette méthodologie permet d'identifier les sociétés dont les activités ont des incidences négatives sur les facteurs de durabilité, tel que décrit précédemment.

☐ Non



Quelle est la stratégie d'investissement suivie par ce produit financier ?

Pour réaliser son objectif de gestion le fonds adoptera la stratégie de gestion suivante :

Le fonds est géré via une réplique physique de l'indice Solactive Transatlantique Planete Index 5 % AR en investissant au moins 90 % de son actif dans les actions de l'indice à la date de constatation initiale et en restant à tout moment investi dans les actions de l'indice. Cet indice évalue ou inclut ses constituants en fonction de caractéristiques climatiques alignées sur les caractéristiques environnementales promues par le fonds.

Afin de gérer sa trésorerie, le fonds pourra investir en OPC bénéficiant du label ISR, dans la limite de 10 % de son actif net.

La stratégie

d'investissement guide les décisions d'investissement selon des facteurs tels que les objectifs d'investissement et la tolérance au risque.

● Quelles sont les contraintes définies dans la stratégie d'investissement pour sélectionner les investissements afin d'atteindre chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par ce produit financier ?

L'univers d'investissement initial est constitué des sociétés listées en Allemagne, France et Etats-Unis dénommé « indice parent ».

De cet univers d'investissement sont uniquement retenues les valeurs qui respectent les critères de capitalisation boursière minimum (flottant supérieur à 2 milliards d'euros) et de liquidité quotidienne minimale (supérieure à 10 millions d'euros par jour), la liquidité étant entendue comme la moyenne des montants échangés sur les 3 derniers mois.

Afin de répondre aux critères de la réglementation EU 2019/2089 « EU Paris Aligned Benchmark », les entreprises qui ne respectent pas les normes internationales (« Global Compact » des Nations Unies), ou qui extraient un certain niveau de leur chiffre d'affaires du charbon, du pétrole ou du gaz, ou encore qui sont impliquées dans des activités contestables (armes controversées, production de tabac) sont également exclues.

Un deuxième filtre consiste à exclure, selon une approche dite « Best-in-Class », les sociétés avec le moins bon score « MSA » (Mean Species Abundance). Il s'agit d'un indicateur qui a pour but de mesurer les surfaces au sol artificialisées par les activités d'une entreprise que ce soit directement (par son usage propre) ou indirectement (utilisées par sa chaîne d'approvisionnement) (exclusion de 40 % des acteurs par secteur d'activité).

De l'univers initial ainsi filtré, sont retenues 80 sociétés (40 US et 40 françaises ou allemandes) selon leur capitalisation boursière.

Enfin, une optimisation sous contraintes, avec une réduction d'au moins 50 % de l'empreinte MSA et un respect de toutes les contraintes climatiques indiquées dans la réglementation « EU Paris Aligned Benchmark » (risques de transition climatique, alignement sur une trajectoire de décarbonation, part verte des investissements, liquidité, pondération limite) est menée afin de s'assurer que l'indice respecte simultanément une réduction d'au moins 50 % de l'intensité carbone à l'initiation (Émissions scope 1, 2 et 3) par rapport à l'univers de départ « indice parent » et une réduction moyenne annuelle de 7 % de son intensité carbone. Au sein de l'indice, les expositions aux secteurs à fort impact climatique sont au moins équivalentes à l'exposition de ces secteurs dans l'univers de départ. Enfin, cet indice respecte une pondération minimum de 50% de valeurs dont les trajectoires climatiques sont certifiées "1,5°C" ou "bien au-dessous 2°C" par l'initiative Science Based Targets. La recomposition de l'indice est trimestrielle.

● **Dans quelle proportion minimale le produit financier s'engage-t-il à réduire son périmètre d'investissement avant l'application de cette stratégie d'investissement ?**

Non pertinent pour ce produit.

● **Quelle est la politique mise en œuvre pour évaluer les pratiques de bonne gouvernance des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ?**

Les pratiques de gouvernance des sociétés sont prises en compte de manière limitée dans la construction de l'indice de référence répliqué physiquement par le fonds. Cela vise essentiellement à exclure des sociétés contrevenant de façon grave et/ou récurrente aux principes du Pacte Mondial des Nations Unies.

Les pratiques de **bonne gouvernance** concernent des structures de gestion saines, les relations avec le personnel, la rémunération du personnel et le respect des obligations fiscales.



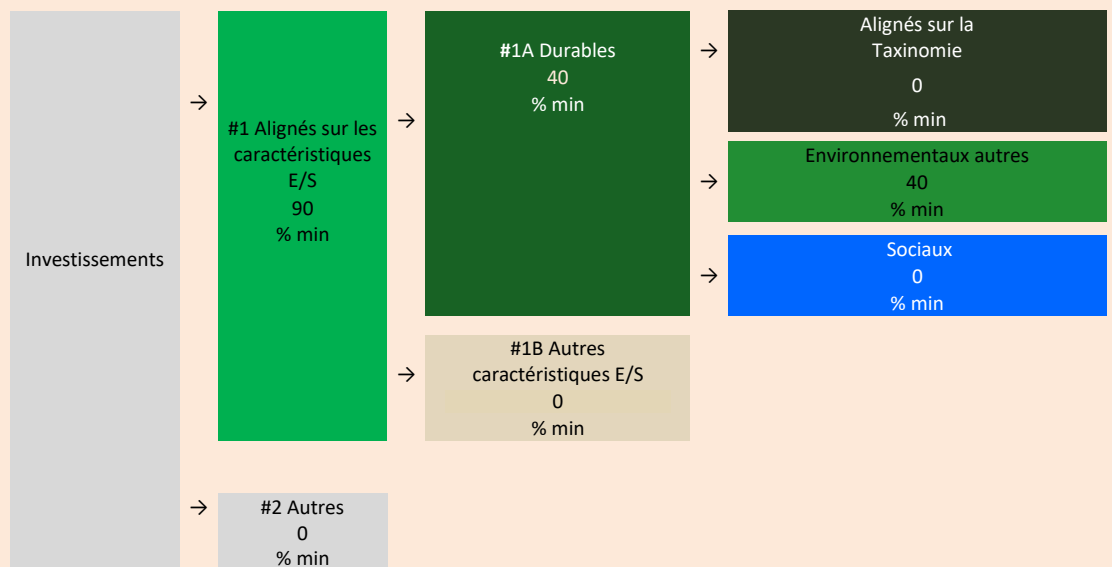
Quelle est l'allocation des actifs prévue pour ce produit financier ?

L'allocation des actifs prévue pour ce produit financier est décrite en détail dans la documentation réglementaire du fonds (prospectus / règlement). En complément, l'allocation en matière extra-financière est précisée ci-après.

L'**allocation des actifs** décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit; des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ; des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables ayant des objectifs environnementaux ou sociaux;
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Comment l'utilisation de produits dérivés permet-elle d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

Les produits dérivés ne sont pas utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le fonds.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solution de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



Dans quelle proportion minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental sont-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le fonds investira au minimum 0 % de son portefeuille dans des activités alignées avec la Taxinomie européenne. Ainsi, bien que le fonds puisse investir dans des activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement (UE) 2020/852 ("Règlement Taxinomie"), il ne s'engage pas à investir dans des investissements durables qui sont alignés sur les critères du Règlement Taxinomie.

● Le produit financier investit-il dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹?

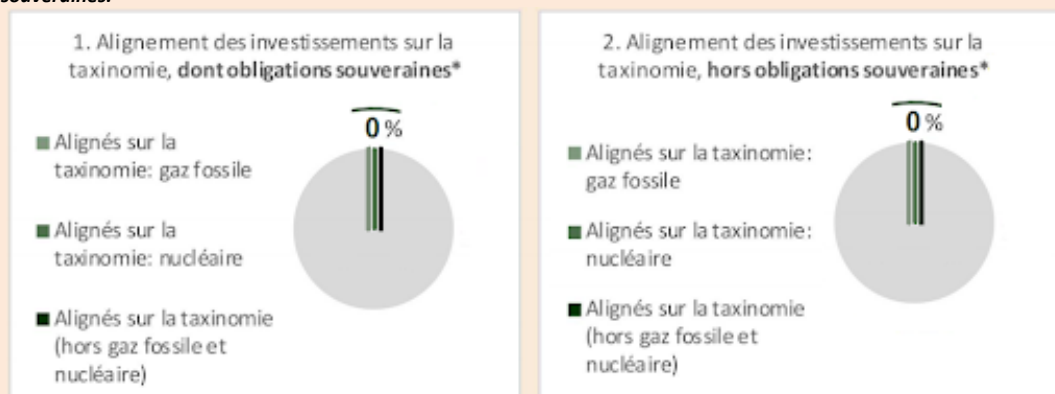
☐ Oui :

☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans le nucléaire

☒ Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique ("atténuation du changement climatique") et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



Ce graphique représente 100% des investissements totaux

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle est la proportion minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Transitoires : 0 %

Habilitantes : 0 %

Le symbole



représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



Quelle est la proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

La proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE est de 40 %. En effet, le fonds investira à hauteur de 40 % de son actif dans des entités dont la trajectoire climatique est certifiée "1,5°C" ou "bien au-dessous "2°C" par l'initiative Science Based Targets.



Quelle est la proportion minimale d'investissements durables sur le plan social ?

Non pertinent pour ce produit.



Quels sont les investissements inclus dans la catégorie "#2 Autres", quelle est leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquent-elles à eux ?

Les investissements inclus dans cette catégorie sont les liquidités ainsi que les produits dérivés utilisés à des fins de couverture et/ou d'exposition. Du fait de leur nature, ces produits ne prennent pas en compte les enjeux environnementaux et sociaux..



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Un indice spécifique a-t-il été désigné comme indice de référence pour déterminer si ce produit financier est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut ?

L'indice spécifique désigné comme indice de référence pour déterminer si le fonds est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut est l'indice Solactive Transatlantique Planete Index 5 % AR. Cet indice est répliqué physiquement par le fonds et la formule du fonds est indexée sur cet indice.

● *Comment l'indice de référence est-il aligné en permanence sur chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?*

L'indice de référence évalue ou inclut ses constituants en fonction de caractéristiques climatiques et est donc aligné sur les caractéristiques environnementales promues par le portefeuille. La reconstitution de l'indice est trimestrielle et les pondérations des valeurs sont variables car elles résultent de l'optimisation sous contrainte. Ces dispositions permettent d'actualiser les composantes de l'indice de référence et de les faire évoluer pendant la durée de vie du fonds.

● *Comment l'alignement de la stratégie d'investissement sur la méthodologie de l'indice est-il à tout moment garanti ?*

L'indice est répliqué physiquement en totalité.

● *En quoi l'indice désigné diffère-t-il d'un indice de marché large pertinent ?*

L'indice de référence diffère d'un indice de marché large pertinent en ce qu'il intègre des critères extra-financiers (caractéristiques climatiques) dans la sélection des titres qui le composent. Il applique également un prélèvement forfaitaire de 5 % par an.

● *Où trouver la méthodologie utilisée pour le calcul de l'indice désigné ?*

Des renseignements supplémentaires sur l'indice, sa composition, son mode de calcul et les règles de révision périodique, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à la conception de l'indice sont disponibles sur le site de Solactive German Index Engineering (www.solactive.com), ticker SOTBIOD5 Index.



Où puis-je trouver en ligne davantage d'informations spécifiques au produit ?

De plus amples informations sont disponibles sur le site internet de la Société de Gestion sur la page dédiée au produit en cliquant sur ce lien.