





Reporting en date de 30/09/2025

# **CONSTRUCTION** DE L'INDICE

#### • Objectifs de l'indice

L'indice Solactive Transatlantique Planete Index 5% AR est composé de grandes entreprises affichant les meilleures pratiques quant à la décarbonation de leurs activités permettant 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

### • Méthode de construction de l'indice

Il s'agit d'un indice des marchés actions de la zone transatlantique, calculé, mis à jour et publié par Solactive qui présente les caractéristiques suivantes :

- 1. L'univers d'investissement de départ est composé de titres de grandes et moyennes capitalisation listés en France, Allemagne et Etats-Unis (700 valeurs), dénommé « indice parent » pour les comparaisons.
- 2. De cet univers d'investissement ne sont retenues uniquement les valeurs qui respectent les critères de capitalisation boursière minimum (flottant supérieur à 2 milliards d'euros) et de liquidité quotidienne minimale (supérieure à 5 millions d'euros par jour).
- 3. 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 ensuite exclues à leur tour.
- **4.** Un deuxième filtre spécifique est appliqué afin d'exclure de l'univers d'investissement les sociétés controversées de façon grave sur des sujets environnementaux, sociaux et de gouvernance.
- **5.** Dans l'univers investissable ainsi défini l'indice se compose des 40 titres de la zone États-Unis et 40 titres de la zone France et Allemagne ayant les capitalisations flottantes les plus élevées.
- **6.** Enfin, une optimisation avec un respect de toutes les contraintes indiquées dans la réglementation « EU Paris Aligned Benchmark » (risques de transition climatique, opportunités sur le climat, liquidité, pondération limite) est conduite pour pondérer les 80 valeurs qui constituent l'indice Solactive Transatlantique Planete index 5% AR. Cet indice respecte 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. Cet indice respecte aussi pour ses constituants considérés dans leur ensemble une réduction moyenne annuelle de 7% de son intensité carbone et une exposition aux secteurs à fort impact climatique est au moins équivalente à l'exposition de l'univers de départ à ces secteurs. Enfin, cet indice respecte une pondération minimum de 50% de valeurs certifiées "1,5°C" ou "bien au-dessous 2°C" par l'initiative Science Based Targets.
- 7. La recomposition de l'indice est trimestrielle et les pondérations des valeurs sont variables car elles résultent de l'optimisation sous contraintes. 100% des dividendes nets sont réinvestis et un prélèvement de 5% forfaitaire est extrait chaque année. L'ensemble des données extra financières sont fournies par ISS et Iceberg Data Lab

#### **FN RÉSUMÉ**

## **TICKER BLOOMBERG**

SOTBIOD5 Index

#### DATE DE LANCEMENT

14/07/2023

#### AGENT DE CALCUI

Solactive

## UNIVERS DE RÉFÉRENCE

Actions Transatlantique

#### DEVISE

Euro (non couvert)

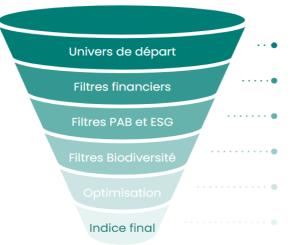
#### FRÉQUENCE REBALANCEMENT

Trimestrielle

#### DIVIDENDE SYNTHETIQUE

5%

# **PROCESSUS** DE CREATION DE L'INDICE



Univers Large France-Allemagne-USA (700 valeurs)

Liquidité et capitalisation boursière

Normes internationales, activités contestables, controverses, SBTi...

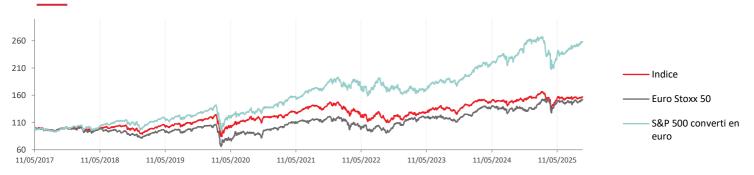
Mean Species Abundance Intensity

-50% intensité de l'univers, -7% intensité p.a et exposition aux secteurs à fort impact climatique

80 valeurs : 40 valeurs USA + 40 valeurs France-Allemagne

Pondération par optimisation sous contraintes Réinvestissement des div. nets avec decrement 5%

# **COMPARAISON DES PERFORMANCES**



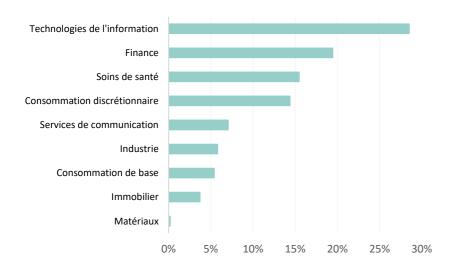
\* base 100 au 11/05/2017

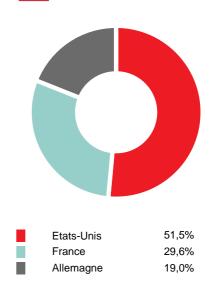
# INDICATEURS DE PERFORMANCES DU PORTEFEUILLE (DEPUIS 11/05/2017)

	Rendement annualisé	Volatilité	Sharpe	Max drawdown
Indice	5,54%	16,27%	0,34	-32,64%
Euro Stoxx 50	5,17%	18,94%	0,27	-38,27%
S&P 500 (converti en euro)	11,99%	20,08%	0,60	-33,72%

# **RÉPARTITION SECTORIELLE**

# **RÉPARTITION** GÉOGRAPHIQUE





## **PRINCIPALES LIGNES DU PORTEFEUILLE**

Nom	Secteur	Pays	Poids
NVIDIA CORP	Technologies de l'information	Etats-Unis	5,3%
APPLE INC	Technologies de l'information	Etats-Unis	4,5%
TESLA INC	Consommation discrétionnaire	Etats-Unis	3,6%
BROADCOM INC	Technologies de l'information	Etats-Unis	3,3%
VISA INC-CLASS A SHARES	Finance	Etats-Unis	2,9%
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	Consommation discrétionnaire	France	2,4%
SCHNEIDER ELECTRIC SE	Industrie	France	2,3%
ESSILORLUXOTTICA	Soins de santé	France	2,3%
KERING	Consommation discrétionnaire	France	2,2%
ALLIANZ SE-REG	Finance	Allemagne	2,2%

\* Liste complète présente sur le site de Solactive

Sources du document : Bloomberg, Arkéa Asset Management et Solactive

Page 2/2

Données arrétées au 30/09/2025



Le présent document est purement informatif et ne constitue ni une offre de souscription, d'achat ou de toute autre transaction portant sur les instruments qui y sont visés, ni un conseil personnalisé d'investissement. Les futurs investisseurs doivent entreprendre les démarches nécessaires afin de déterminer eux-mêmes et/ou avec le concours de leurs conseillers l'adéquation de leur investissement, en fonction des considérations légales, fiscales et comptables qui leur sont applicables ainsi que leur sensibilité aux risques inhérents aux intruments financiers.

Solactive ne garantit pas la qualité, la précision et/ou l'intégralité de l'indice ou des données qui y comprennent. Solactive n'offre aucune garantie, expresse ou implicite, quant aux résultats à obtenir par le licencié, les propriétaires du ou des produit(s) ou toute autre personne ou entité de l'utilisation de l'indice ou de toutes les données qui y comprennent. Solactive n'offre aucune garantie expresse ou implicite, et décline expressément toute garantie de qualité marchande ou d'adaptation à un usage particulier concernant l'indice ou toutes ses données. Solactive ne sera en aucun cas responsable pour toute perte de profits, dommages spéciaux, indirects, accessoires ou consécutifs même si notifié de la possibilité de tels dommages.

Arkéa Asset Management SA à Directoire et Conseil de Surveillance. Siège social : 1, allée Louis Lichou 29480 LE RELECQ-KERHUON Siren 438 414 377 RCS Brest. Agrément de l'Autorité des Marchés Financiers – n° GP 01-036 – TVA : FR 64 438 414 377