

CONSTRUCTION DE L'INDICE

● Objectifs de l'indice

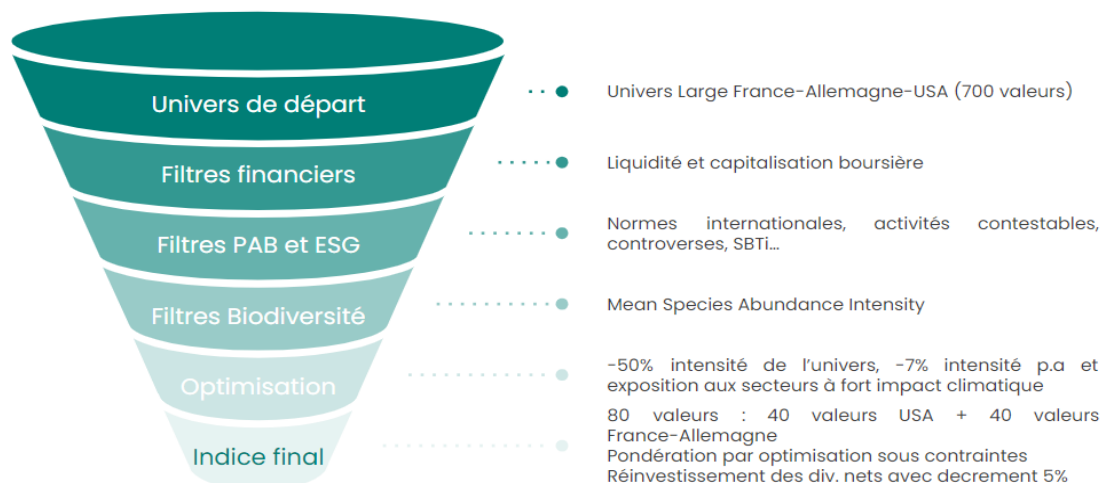
L'indice Solactive Transatlantique Planete Index 5% AR est composé de grandes entreprises affichant les meilleures pratiques quant à la décarbonation de leurs activités permettant la limitation de la hausse des températures à 1.5°C à horizon 2100 et ce conformément aux engagements entérinés par l'Accord 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 reconstitution 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

PROCESSUS DE CREATION DE L'INDICE



EN RÉSUMÉ

TICKER BLOOMBERG

SOTBIOD5 Index

DATE DE LANCEMENT

14/07/2023

AGENT DE CALCUL

Solactive

UNIVERS DE RÉFÉRENCE

Actions Transatlantique

DEVISE

Euro (non couvert)

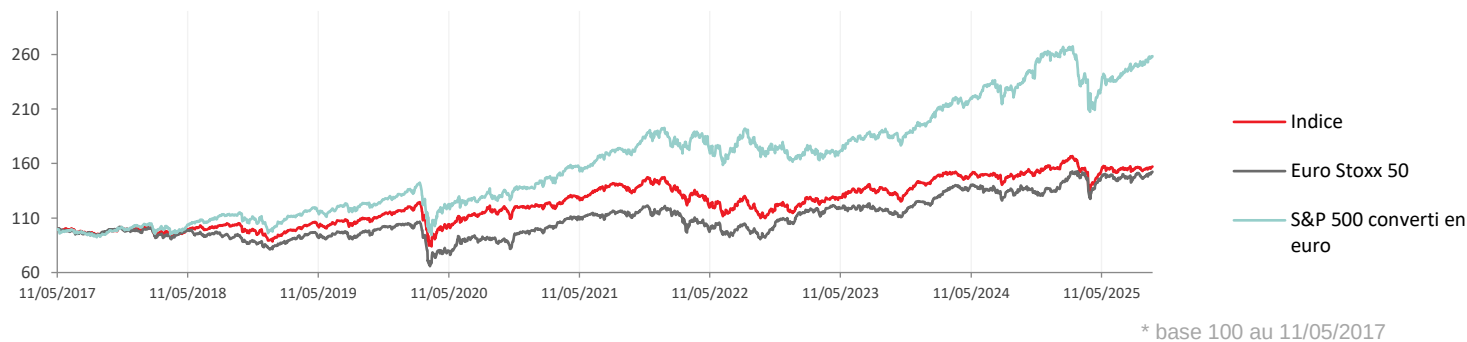
FRÉQUENCE REBALANCEMENT

Trimestrielle

DIVIDENDE SYNTHÉTIQUE

5%

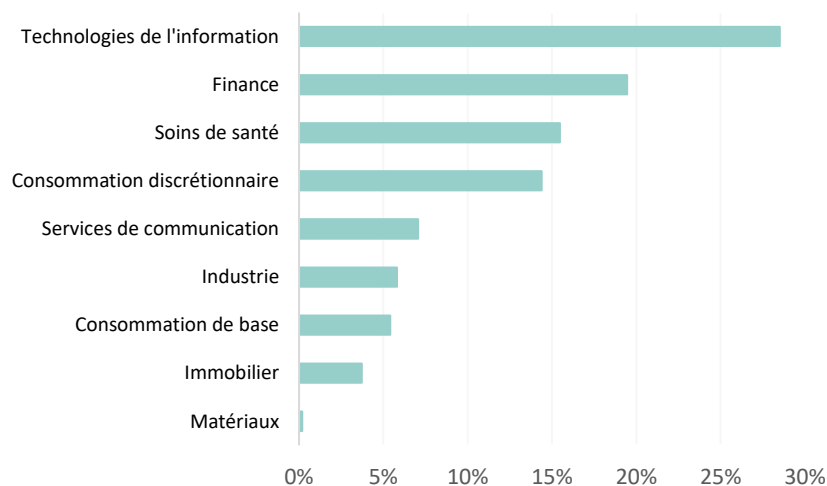
COMPARAISON DES PERFORMANCES



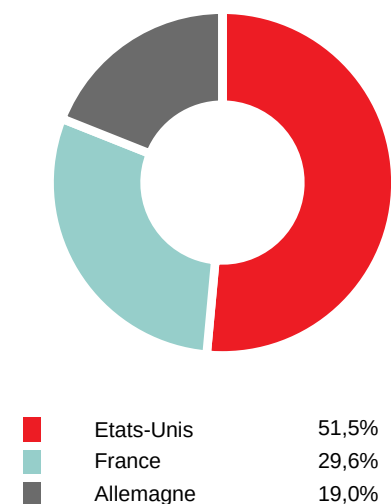
INDICATEURS DE PERFORMANCES DU PORTEFEUILLE (DEPUIS 11/05/2017)

	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 arrêtées au 30/09/2025