

**Informations précontractuelles pour les produits financiers visés à
l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, 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 bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

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.

Dénomination du produit : Thematics AAA European Selection

Identifiant d'entité juridique : 969500QXNXXS3MAN6B46

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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 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 ____% 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 ☐ ayant un objectif environnemental 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



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

Le fonds investit dans des sociétés européennes exposées à une ou plusieurs des tendances structurelles mondiales suivantes : l'eau, la sécurité, le bien-être, l'intelligence artificielle et la robotique ainsi que l'économie basée sur les abonnements. Il cherche à promouvoir les facteurs ESG en sélectionnant des sociétés exposées aux thèmes abordés, en évitant les sociétés exposées à des activités controversées, les sociétés non conformes aux normes mondiales de développement durable et les sociétés exposées à des controverses ESG importantes à graves ainsi qu'en maintenant un meilleur score ESG que l'univers investissable, tout en participant activement aux votes et en s'engageant activement auprès de sociétés dans lesquelles il investit. Aucun indice de référence n'a été désigné aux fins d'atteindre les caractéristiques E/S promues par le

Les indicateurs de durabilité évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

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

Le Fonds prévoit rendre compte annuellement des éléments suivants :

- Pourcentage de l'actif sous gestion du fonds qui contribue au thème.
- Pourcentage de l'actif sous gestion du fonds tirant plus de 5 % de ses revenus d'activités nuisibles et/ou controversées.
- Pourcentage de l'actif sous gestion du fonds qui provient d'émetteurs dont la conduite et la performance globale sont considérées comme non conformes aux normes et principes de développement durable établis à l'échelle mondiale, qui régissent le comportement des entreprises.
- Pourcentage de l'actif sous gestion du fonds qui fait l'objet d'une analyse ESG par les gérants de portefeuille.
- Note ESG du portefeuille par rapport à la note de l'univers investissable (mesurée en tant que moyenne mobile sur 3 mois de la note hebdomadaire), après avoir éliminé au moins 20 % des titres les moins bien notés de ce dernier.
- Pourcentage de l'actif sous gestion du fonds qui provient d'émetteurs nouvellement acquis ayant d'ores et déjà des controverses ESG de niveau élevé et/ou grave au moment de l'investissement.
- Nombre d'émetteurs déjà acquis, exposés à des controverses ESG de niveau élevé et/ou grave et qui, dans un délai de 6 mois :
 - ne sont pas engagés ou,
 - sont engagés, mais ne parviennent pas à améliorer suffisamment leurs performances.
- Pourcentage total de votes soumis.
- Pourcentage de votes soumis conformément à la politique de développement durable.
- Pourcentage d'actifs sous gestion relevant de l'engagement ciblé.

● **Quels sont les objectifs des investissements durables que le produit financier entend partiellement réaliser et comment l'investissement durable contribue-t-il à ces objectifs ?**

Not applicable

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

Non applicable

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

Non applicable

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.

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 :

Non applicable

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 et qui s'accompagne de critères spécifiques 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

Thematics AM considère les Principales Incidences Négatives (PAI en anglais) de la SFDR à différentes étapes de son processus d'investissement grâce à ses 4 approches de développement durable : exclusion, évaluation basée sur des normes, intégration ESG, vote et engagement.

- Nous excluons les sociétés qui présentent les PAI suivantes : celles qui sont exposées à des armes controversées ; celles qui génèrent plus de 5 % de leurs revenus à partir des combustibles fossiles ; celles qui ne respectent pas les principes du Pacte mondial des Nations Unies et les directives de l'Organisation de coopération et de développement économiques (OCDE) pour les entreprises multinationales ; et les sociétés du secteur de l'énergie dont l'intensité GES n'est pas conforme aux dispositions de l'Accord de Paris.
- Dans le cadre de notre exclusion basée sur la conduite/les normes, nous prenons en compte les PAI suivantes : nous excluons les sociétés qui ne se sont pas dotées de processus et de mécanismes de conformité pour surveiller le respect des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des directives de l'OCDE pour les entreprises multinationales ainsi que celles impliqués dans des activités ayant une incidence négative sur les zones sensibles à la biodiversité.
- Dans le cadre de notre intégration des critères ESG, où nous accordons une note aux entreprises en fonction d'indicateurs ESG significatifs, nous prenons en compte les PAI suivantes : Émissions et intensité des GES ; empreinte carbone ; intensité de la consommation énergétique par secteur climatique à forte incidence ; activités ayant un impact négatif sur les zones sensibles à la biodiversité ; émissions dans l'eau ; ratio de déchets dangereux ; diversité en matière de genre au sein des conseils décisionnels ; part de la consommation et de la production d'énergie non renouvelable ; écart de rémunération

non ajusté entre les sexes.

- Après l'investissement, nous votons en conformité avec nos principes de développement durable et ciblons les entreprises de manière à mettre en place un engagement formel, y compris avec celles qui ne se sont pas dotées des processus et mécanismes de conformité nécessaires pour surveiller la conformité aux principes du Pacte mondial des Nations unies et aux directives de l'OCDE pour les entreprises multinationales, ainsi que les sociétés qui ne possèdent pas de procédures de divulgation et de gouvernance sur les émissions de GES et leur intensité ; l'empreinte carbone et l'écart de rémunération non ajusté entre les sexes.

Des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité sont disponibles dans les rapports périodiques du fonds conformément à l'article 11(2) du règlement SFDR.

☐ Non



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

Quelle stratégie d'investissement ce produit financier suit-il ?

1. Filtrage thématique positif

Les gérants de portefeuille sélectionnent des titres dont les solutions satisfont aux deux critères ci-après :

- contribuer aux sous-segments du thème qui, à leur tour, contribuent à 1 ou plusieurs des cibles de développement durable suivantes : efficacité de l'utilisation de l'eau, retraits d'eau durables, technologies de traitement de l'eau, technologies avancées de gestion de l'eau ; gestion des déchets dangereux, surveillance de la pollution ; infrastructure d'approvisionnement en eau et de livraison d'eau ; optimisation de l'utilisation des ressources, atténuation et résilience du climat, santé et sécurité, amélioration de la qualité et de l'accès aux soins de santé, et maisons et villes intelligentes ; sécurité alimentaire et sanitaire, confidentialité des données et protection des consommateurs, accès amélioré et sécurisé à l'économie numérique, aux systèmes de transport et de mobilité sûrs, aux systèmes de sécurité personnels et industriels et à d'autres systèmes de sécurité avancés ; accès amélioré aux produits et services de santé physique et mentale et de bien-être, accès amélioré aux produits et services pour les besoins humains de base, y compris la nourriture, la santé et l'éducation, et promotion d'un travail décent et significatif ; consommation responsable et durable, économie circulaire économe en ressources, atténuation des effets sur le climat et résilience climatique et accès amélioré à l'éducation et à d'autres services de base.
- répondre aux exigences de matérialité ou de leadership du thème.
 - Matérialité : l'émetteur doit générer au moins 20 % de ses revenus et/ou bénéfices à partir des produits concernés dès aujourd'hui ou dans les 3 à 5 ans.
 - Exigences en matière de leadership : les produits de l'émetteur doivent, de l'avis des gérants de portefeuille, être à la pointe du secteur, être innovants ou potentiellement disruptifs.

2. Exclusion basée sur l'activité

Les gérants de portefeuille procèdent à un contrôle plus approfondi de l'univers investissable en excluant les titres exposés à des activités nuisibles et controversées comme le charbon, le pétrole et le gaz conventionnels, les armes non conventionnelles etc. Pour plus d'informations, veuillez consulter notre politique d'exclusion sous: <https://www.thematics-am.com/being-responsible/reports-and->

[publications](#)

3. Exclusion basée sur la conduite

En outre, les Gestionnaires financiers excluent systématiquement les titres de sociétés dont la conduite et la performance globales sont considérées comme non conformes aux normes et principes de développement durable établis à l'échelle mondiale pour régir la conduite des entreprises, en particulier en matière de protection de l'environnement, de droits de l'Homme, de droits du travail et d'éthique commerciale. Ces normes comprennent les principes du Pacte mondial des Nations unies, les principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales, les principes directeurs des Nations unies pour le commerce et les droits de l'Homme et les Conventions internationales du travail. Le filtrage s'appuie sur des données fournies par des prestataires externes.

4. Lors de la phase finale de construction du portefeuille, les gérants de portefeuille effectuent des analyses ESG en appliquant leur méthode d'évaluation ESG exclusive, qui s'appuient sur des cadres établis en matière de priorité tels que, sans s'y limiter, le Sustainability Accounting Standards Board (SASB) et la Global Reporting Initiative (GRI). Les gérants de portefeuille notent chaque société en fonction de 11 indicateurs environnementaux, sociaux et de gouvernance différents en s'appuyant sur une gamme de ressources, y compris la recherche documentaires, l'engagement auprès de la société et les données d'au moins deux agences de notation tierces (ISS et Sustainalytics). La note ESG totale a la même pondération (25 %) que les autres critères de placement (c.-à-d. qualité, risque de négociation et gestion) et aura un impact sur l'inclusion du titre et sur le poids final de l'investissement. La revue des critères ESG couvre en permanence au moins 90% de l'actif net du Fonds.
5. Afin de mesurer l'efficacité de l'approche ESG mise en œuvre, le gérant de portefeuille s'assure que le fonds aura une meilleure notation ESG que son univers d'investissement (mesurée comme la moyenne roulante sur 3 mois du score hebdomadaire), après avoir éliminé au moins 20 % des titres les moins bien notés de ce dernier, sur la base d'une notation du risque ESG par un tiers externe.
6. Les entreprises exposées à des controverses de niveau élevé et/ou grave sont exclues. Si la société est déjà en portefeuille et est exposée à des risques élevés et/ou graves les gérants plafonneront la position à 2 %. En outre, un engagement ciblé avec l'entreprise est initié. Le plafond sera levé si une amélioration suffisante de la performance est démontrée dans les 6 mois. Les gérants d'investissement se retireront du placement si les progrès sont insuffisants.
7. THEMATICS AM a l'intention d'exercer 100 % des droits de vote sur les émetteurs des titres détenus dans les portefeuilles gérés, et conformément à sa politique de vote fondée sur des principes de durabilité.
8. Thématiques AM a l'intention d'engager avec un certain pourcentage d'émetteurs chaque année.

Quels sont les éléments contraignants de la stratégie d'investissement utilisés pour sélectionner les investissements afin d'atteindre chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par ce produit financier ?

1. Le pourcentage de l'actif sous gestion du fonds qui contribue au thème et répond aux critères de matérialité ou de leadership s'élève à 100 % hors liquidités.
2. Pourcentage de l'actif sous gestion du fonds tirant plus de 5 % de ses revenus d'activités nuisibles et/ou controversées est de 0%.
3. Le pourcentage de l'actif sous gestion du fonds provenant d'émetteurs dont la conduite et la performance globale sont considérées comme non conformes aux normes et principes de développement durable établis à l'échelle mondiale pour régir la conduite des entreprises est de 0 %.

4. Le pourcentage de l'actif sous gestion du fonds faisant l'objet d'une analyse ESG par les gérants financiers est de 100 %.
5. La note ESG du portefeuille surperforme la note ESG de l'univers investissable (mesurée en tant que moyenne mobile sur 3 mois de la note hebdomadaire), après avoir éliminé au moins 20 % des titres les moins bien notés de cette dernière sur la base de la note de risque ESG attribuée par un prestataire externe.
6. 6.1 Le pourcentage de l'actif sous gestion du fonds provenant d'émetteurs nouvellement acquis ayant d'ores et déjà des controverses ESG de niveau élevé et/ou grave au moment de l'investissement est de 0 %
 6.2 Le nombre d'émetteurs déjà acquis, exposés à des controverses ESG de niveau élevé et/ou grave et plafonnés à 2 % est de 5 maximum.
 6.3 Le nombre d'émetteurs déjà acquis, exposés à des controverses ESG de niveau élevé et/ou grave et qui, dans un délai de 6 mois :
 - ne sont pas engagés ou,
 - sont engagés, mais ne parviennent pas à améliorer suffisamment leurs performances, est de 0.
7. 7.1 Le pourcentage total de votes soumis est de 95 % minimum.
 7.2 Le pourcentage de votes soumis conformément à la politique de développement durable est de 95 % minimum.
8. Le pourcentage d'actifs sous gestion relevant de l'engagement ciblé est de 5 % minimum.

● **Quel est le taux minimal d'engagement pour réduire la portée des investissements envisagés avant l'application de cette stratégie d'investissement ?**

Le taux minimal d'engagement pour réduire la portée des investissements envisagés avant l'application de cette stratégie d'investissement est de 20%.

● **Quelle est la politique suivie pour évaluer les pratiques de bonne gouvernance des sociétés bénéficiaires des investissements ?**

Nous encourageons la bonne gouvernance tout au long du processus d'investissement en appliquant les éléments suivants : exclusion basée sur la conduite, issue de l'évaluation de la gouvernance et des performances de la société sur divers indicateurs de gouvernance ; évaluation ESG, qui comprend des indicateurs de gouvernance importants tels que la qualité du conseil d'administration, l'éthique commerciale, la rémunération et la protection des actionnaires ; et vote et engagement sur des questions de gouvernance ciblées, notamment la gestion du développement durable et la transparence.

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

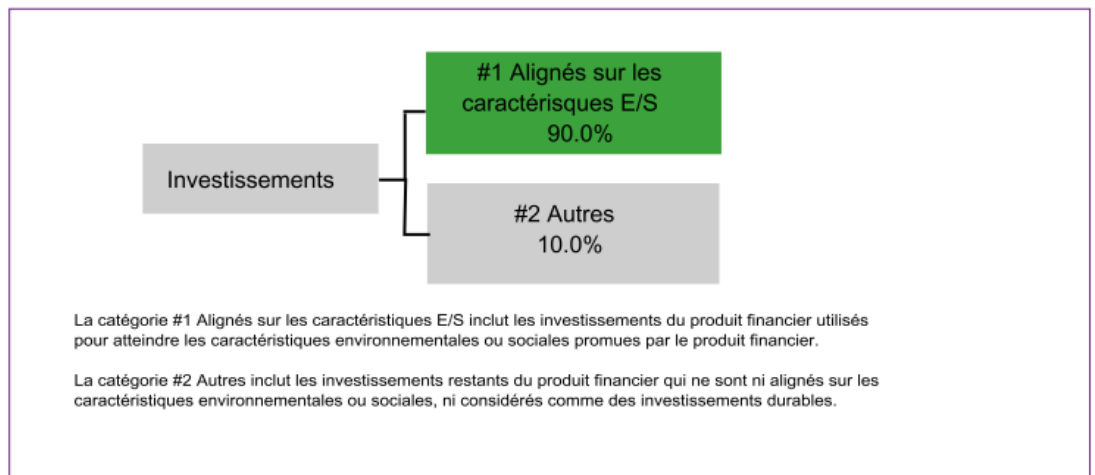
Le fonds devrait investir au moins 90% de son actif net dans des sociétés qui répondent aux critères d'alignement avec les caractéristiques E/S (#1).

Le fonds devrait investir jusqu'à 10% de son actif net dans des liquidités, des équivalents et/ou instruments de couverture (#2 Autres).

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.



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.



● **Comment l'utilisation de produits dérivés atteint-elle 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.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **Du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ; des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **Des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.



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

La société de gestion estime préférable, par mesure de prudence, d'indiquer un engagement sur la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnement aligné sur la taxinomie de 0%. Toutefois, la position sera réexaminée au fur et à mesure que les règles sous-jacentes seront finalisées et que la disponibilité de données fiables augmentera au fil du temps.

● **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 l'énergie 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 (EU) 2022/1214 de la Commission.

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

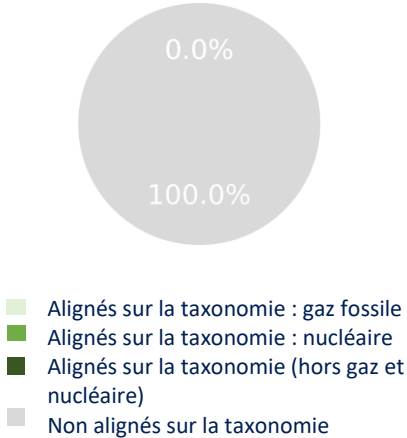
Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

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

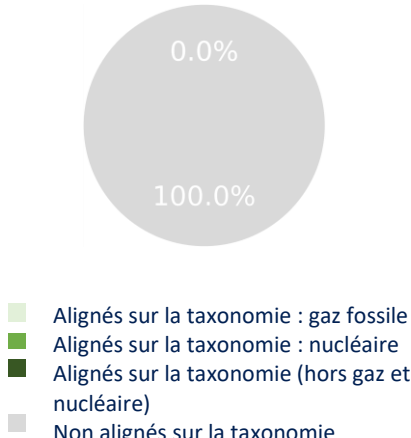
Le symbole  représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

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.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, **obligations souveraines incluses***



2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors **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 part minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes ?**

La part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie est de 0%. Par conséquent, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens du Règlement européen sur la taxinomie est donc également fixée à 0 %.



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

Le Fonds promeut des caractéristiques environnementales et sociales mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables. Par conséquent, le Fonds ne s'engage pas sur une part minimale d'investissements durables avec un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.



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

Non applicable



Quels investissements sont inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle est leur finalité et existe-t-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

Investissement en liquidités à des fins de gestion de la trésorerie.

Les garanties environnementales ou sociales minimales ne sont pas systématiquement appliquées.



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 promet ?

Non applicable

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

Non applicable

- ***Comment l'alignement de la stratégie d'investissement sur la méthodologie de l'indice est-il garanti en permanence ?***

Non applicable

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

Non applicable

- ***Où trouver la méthode utilisée pour le calcul de l'indice désigné ?***

Non applicable



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

De plus amples informations sur le produit sont accessibles sur le site internet :

<https://www.im.natixis.com/fr/funds/thematics-aaa-european-selection/fr0010152967>