

Modèle d'informations périodiques 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

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 a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ____%

dans des activités qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxonomie de l'UE

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

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ____%

Il promouvait des **caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion 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 taxonomie 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 taxonomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

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 **taxonomie 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 taxonomie.



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le fonds a investi 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

Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

abonnements. Il a promu 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 de niveau élevé et/ou grave 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 Fonds.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Sauf indication contraire, les données sont au 30/12/2022 :

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. Le pourcentage de l'actif sous gestion du fonds des émetteurs 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 des 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. le Gestionnaire Financier utilise l'approche de la sélectivité par rapport à l'univers investissable en réduisant au minimum de 20% l'univers d'investissement par l'exclusion des titres les plus mal notés.
6. 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 0, ce qui est inférieur au maximum de 5.
 - 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. Le pourcentage total de votes soumis en 2022 est de 100%, ce qui est supérieur au 95 % minimum.
 - 7.2 Le pourcentage de votes soumis conformément à la politique de développement durable en 2022 est de 100%, ce qui est supérieur au 95 % minimum.
8. Le pourcentage d'émetteurs ciblés par l'engagement est de 6%, ce qui est supérieur au 5 % minimum.



- **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Non applicable

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé 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 investissements durables étaient-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

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.

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.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Thematics AM a pris en considération les Principales Incidences Négatives obligatoires (PAI en anglais) de 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.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
ASML HOLDING NA EUR	Équipement de semi-conducteurs	5.23%	Pays-Bas
WOLTERS NA EUR	Services de Recherche et Conseil	5.08%	Pays-Bas
EUROFINS FP EUR	Outils et Services Appliqués aux Sciences Biologiques	5.05%	Luxembourg
VEOLIA FP EUR	Services aux collectivités diversifiés	4.85%	France
ESSILORLUXOTTICA FP	Habillement, accessoires	4.34%	France
JOHNSON UN USD	Produits pour l'industrie du bâtiment	3.76%	Irlande
L'OREAL FP EUR	Produits de soin personnels	3.4%	France
MEDTRONIC PLC UN USD	Équipements médicaux	3.27%	Irlande
KERRY GROUP-A ID EUR	Aliments et viandes conditionnés	3.18%	Irlande
DSM (KONIN) NA EUR	Produits chimiques spécialisés	2.93%	Pays-Bas
PUMA SE GY EUR	Chaussures	2.72%	Allemagne
AMPLIFON SPA IM EUR	Distributeurs de produits de santé	2.70%	Italie
BASIC-FIT NV NA EUR	Installations de loisirs	2.47%	Pays-Bas
WORLDLINE FP EUR	Traitement des données et services externalisés	2.43%	France
SARTORIUS FP EUR	Outils et Services Appliqués aux Sciences Biologiques	2.38%	France

La liste comprend les investissements qui **constituent la plus grande proportion d'investissements** du produit financier à date de référence, à savoir : 30/12/2022



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

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Non applicable.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Le fonds a investi 99.4% de son actif net dans des sociétés qui répondent aux critères d'alignement avec les caractéristiques E/S.

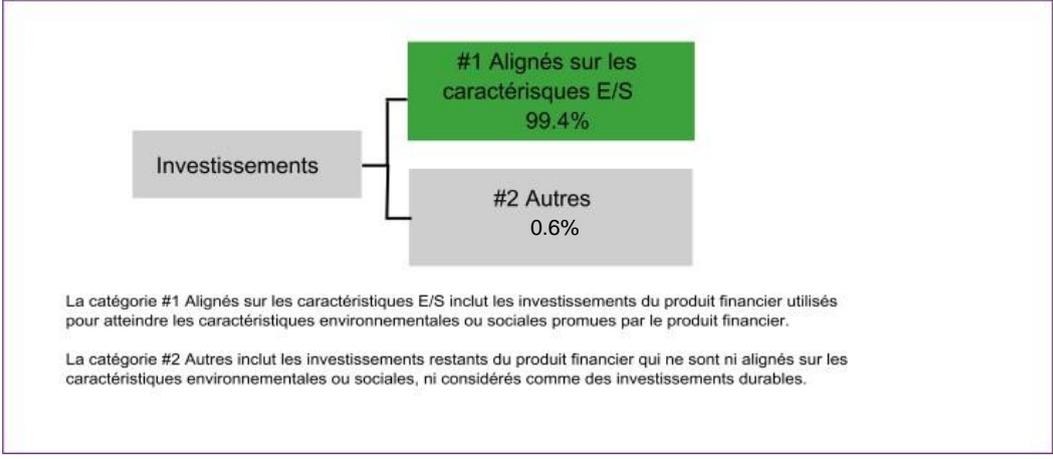
Le fonds détient 0.6% de liquidités.

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.

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.



● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Le fonds a investi dans tous les secteurs économiques E/S sauf celui de l'énergie.

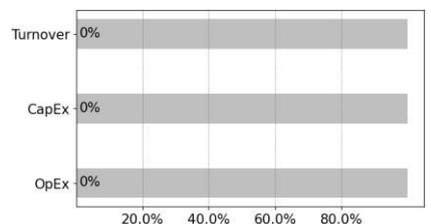


Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Non Applicable

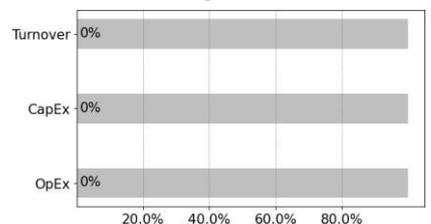
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie 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***



■ Investissements alignés sur la taxinomie
■ Autres investissements

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors **obligations souveraines***



■ Investissements alignés sur la taxinomie
■ Autres investissements

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

- **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Non Applicable



Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxonomie de l'UE ?

Non Applicable



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

Non Applicable



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

Les investissements en liquidités sont réalisés à des fins de gestion de trésorerie.

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



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 taxonomie de l'UE.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

La stratégie d'investissement a été appliquée :

1. Filtrage thématique positif

Les gérants de portefeuille ont sélectionné 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 ont procédé 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 ont exclus 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 ont effectué des analyses ESG en appliquant leur méthode d'évaluation ESG interne, qui s'appuient sur des cadres établis 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 documentaire, 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'est assuré de la sélectivité par rapport à l'univers investissable en réduisant au minimum de 20% l'univers d'investissement par l'exclusion des titres les plus mal notés.
6. Les entreprises exposées à des controverses de niveau élevé avec outlook négatif et/ou grave ont été exclues. Le fonds n'a pas détenu de sociétés qui sont devenues exposées à des risques élevés avec outlook négatif et/ou graves.
7. THEMATICS AM a eu 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 eu l'intention d'engager un certain pourcentage d'émetteurs chaque année.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Non Applicable

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

Non Applicable

- **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Non Applicable

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Non Applicable

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Non Applicable

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