### ANNEXE II

Modèle d'information précontractuelle 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 paragraphe, du règlement (UE) 2020/852

Nom du produit : Sanso Opportunités Identifiant d'entité juridique : 969500QG9BXCU07LGR51

# Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable? Oui Non Il réalisera un minimum Il promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S) et, bien d'investissements durables avec qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement un objectif environnemental:\_% durable, il contiendra une proportion dans des activités minimale de % d'investissements durables économiques qui sont considérées durable sur le ayant un objectif environnemental dans des plan environnemental au titre activités économiques qui sont considérées de la taxonomie de l'UE comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxonomie de l'UE dans des activités économiques qui ne sont pas ayant un objectif environnemental dans considérées comme durables des activités économiques qui ne sont pas sur le plan environnemental considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxonomie au titre de la taxonomie de de l'UE I'UE avec un objectif social Il réalisera un minimum d'investissements durables Il promeut les caractéristiques E/S, mais avec un objectif social: % ne réalise pas d'investissements durables

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.

Par investissement durable on entend un investissement dans

environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause pas de préjudice important à

aucun de ces objectifs et que les sociétés

bénéficiaires des investissements

appliquent des pratiques de bonne

gouvernance.

une activité économique qui contribue à un

objectif



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

Le fonds se limite à investir dans des fonds classés article 8 et 9 SFDR.

De plus, pour la partie en titre vifs, le fonds respecte la politique d'exclusion de Sanso IS qui écarte les armes controversées, le secteur du tabac, les sociétés impliquées dans des activités liées au charbon thermique et les énergies non conventionnelles et les entreprises impliquées dans des controverses graves et répétées relatives au Pacte Mondial des Nations-Unies.

Quels sont les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de

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

מנוכווונכט.

chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par ce produit financier ?

En vertu du règlement SFDR, les fonds relevant de l'article 8 font la promotion des caractéristiques environnementales ou sociales. Les produits poursuivant un objectif d'investissement durable sont dits article 9.

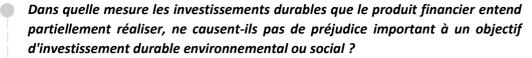
Au travers de l'utilisation des indicateurs de durabilités exposés ci-après, le fonds promeut des caractéristiques environnementales ou sociales, il est donc classé article 8.

Le fonds se limite à investir dans des fonds classés article 8 et 9 SFDR.

Le détail des critères d'exclusion et les sources de données utilisaient est disponible <u>ici</u>.

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 ?

Le fonds n'a pas pour objectif de réaliser des investissements durables.



NΑ

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

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 ?

La taxonomie 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 nt 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



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, à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



Ce produit financier prend-il en considération les principales incidences négatives sur

# les facteurs de durabilité?



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

L'OPCVM a pour objectif de profiter des grandes tendances sur les différentes classes d'actifs (actions européennes et internationales, obligations, monétaire...) tout en essayant de limiter la participation aux phases de baisse de marchés au travers d'une gestion flexible « totalement discrétionnaire » de l'allocation d'actif. Cet objectif rend caduque toute comparaison à un indicateur de référence.

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?

La sélection se limite aux produits classés article 8 ou 9 SFDR.

Pour la partie en titres vifs, le fonds n'investit pas dans les sociétés faisant partie de la liste d'exclusion de Sanso IS.

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

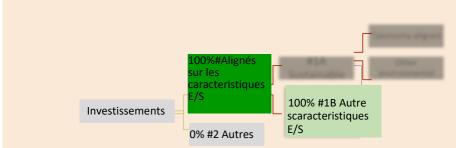
Le fonds n'applique pas de taux minimum pour réduire le champ des investissements.

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

Le fonds n'applique pas de politique d'évaluation des pratiques de bonne gouvernance.

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

L'ensemble des titres en portefeuille promeuvent des caractéristiques sociales et/ou environnementales.



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.

Les activités alignées sur la taxonomie 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
   opérationnelles
   (OpEx) pour refléter
   les activités
   opérationnelles vertes
   des sociétés
   bénéficiaires des
   investissements.

Comment l'utilisation de dérivés atteint-elle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?

Les instruments financiers dérivés pourraient occasionnellement être utilisés à titre de couverture et d'exposition. Ces instruments ne sont pas utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

3

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'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



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

Les deux graphiques ci-dessous indiquent en vert le pourcentage minimum d'investissements qui sont alignés sur la Taxonomie de l'UE. Comme il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement sur la taxonomie des obligations souveraines\*, le premier graphique montre l'alignement sur la taxonomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le second graphique montre l'alignement sur la taxonomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.





\*Aux fins de ces graphiques, les "obligations souveraines" sont constituées de toutes les expositions souveraines.

Quelle est la part minimale d'investissements dans les activités transitoires et habilitantes?

La part minimale des investissements dans les activités transitoires et habilitantes au sens du Règlement européen sur la taxonomie est de 0 % pour les activités transitoires et de 0 % pour les activités habilitantes.



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

NA



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

NA



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

NA

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.

représente des investissements durables avec un

Le symbole



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 ?

NA

- Comment l'indice de référence est-il en permanence aligné sur chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?
- Comment l'alignement de la stratégie d'investissement sur la méthodologie de l'indice est-il garanti en permanence ?
- En quoi l'indice désigné diffère-t-il d'un indice de marché large pertinent ?
- Où trouver la méthode utilisée pour le calcul de l'indice désigné?



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://sanso-is.com/