Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 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.

Dénomination du produit : **Thematics Safety Fund**
Identifiant d'entité juridique : 549300ZORMPGQM0BCW58

Objectif d'investissement durable

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 comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxonomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?	
●● ☒ **Oui**	●● ☐ **Non**
☐ Il a réalisé des **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 ☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxonomie de l'UE	☐ Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu comme objectif un 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
X Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social :** 96,67 %	☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure l'objectif d'investissement durable de ce produit financier a-t-il été atteint ?

Le Fonds a contribué à la protection des actifs, des données, des biens et de la santé des personnes.

Aucun Indice de Référence n'a été désigné dans le but d'atteindre les objectifs d'investissement durable.

Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les objectifs de durabilité de ce produit financier sont atteints.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Sauf indication contraire, les données sont en date du 31 décembre 2022 :

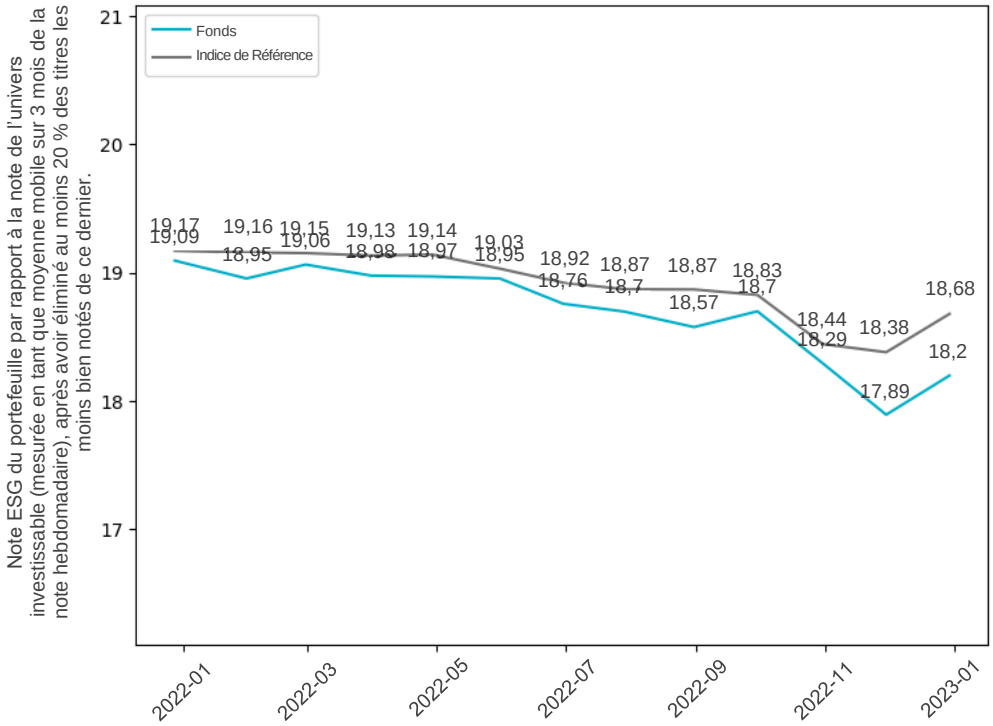
1. Le pourcentage de l'actif sous gestion du Fonds qui contribue aux thèmes et répond aux critères de priorité ou de leadership s'élève à 100 % hors liquidités.

2. Le 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 Gestionnaires 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.

1. Le pourcentage de l'actif sous gestion du Fonds provenant d'émetteurs nouvellement acquis ayant d'ores et déjà des controverses ESG importantes avec des perspectives négatives et/ou graves au moment de l'investissement est de 0 %.

2. Le nombre d'émetteurs déjà acquis, exposés à des controverses ESG importantes avec des perspectives négatives et/ou graves et plafonnés à 2 % est de 0 qui est inférieur au maximum de 5.

3. Nombre d'émetteurs déjà acquis, exposés à des controverses ESG importantes avec des perspectives négatives et/ou graves 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.

1. Le pourcentage total de votes soumis en 2022 est de 100 %, ce qui est supérieur au minimum de 95 %.

2. Le pourcentage de votes soumis conformément à la politique de développement durable en 2022 est de 100 %, ce qui est supérieur au taux de 95 % minimum.

8. Le pourcentage d'actifs sous gestion relevant de l'engagement ciblé est de 13 % , ce qui est supérieur au taux de 5 % minimum.

Dans quelle mesure les investissements durables n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable ?

L'investissement durable n'a pas causé de préjudice important aux autres objectifs E/S en utilisant une combinaison de stratégies contraignantes tout au long du processus d'investissement. Le Fonds a pris en compte les PAI du Règlement européen sur la sécurité des données 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. Pour ce faire, le Fonds rend compte chaque année des éléments suivants : exposition à des activités défavorables couvertes par les PAI, telles que le charbon et les armes ; violation des normes internationales, y compris les Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les Principes directeurs des Nations Unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ; l'exposition à des controverses ESG importantes et graves avec des perspectives négatives ; la note de risque ESG du Fonds par rapport à son univers investissable ; et ses données de performance sur son vote et son engagement basés sur les principes de durabilité.

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.

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

Comme indiqué ci-dessus, le Fonds a pris en compte les PAI du Règlement européen sur la sécurité des données et d'autres critères ESG 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.

i. Le Fonds exclut les sociétés qui présentent les PAI suivantes : celles qui sont exposées à des armes illégales et 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 les émissions de GES ne sont pas conformes aux dispositions de l'Accord de Paris. En plus de ces PAI, le Fonds exclut également les sociétés dont le chiffre d'affaires est exposé à plus de 5 % aux activités suivantes : pétrole et gaz conventionnels, pétrole et gaz non conventionnels, armes conventionnelles, armes légères et tabac. Chaque année, le Fonds rend compte de son exposition à ces indicateurs.

ii. 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 la conformité aux principes du Pacte mondial des Nations unies et aux directives de l'OCDE pour les entreprises multinationales ainsi que les activités qui ont un effet défavorable sur la biodiversité. En outre, le Fonds exclut également les sociétés exposées à un niveau de risque élevé et grave de controverses ESG avec des perspectives négatives [qui n'ont pas une gestion des risques suffisante]. Chaque année, le Fonds rend compte de son exposition à des sociétés non conformes ou à celles exposées à des controverses ESG de niveau de risque élevé ou grave.

iii. 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 ; part de la consommation et de la production d'énergie non renouvelable ; écart de rémunération entre les sexes non ajusté. Chaque année, le Fonds rend compte de sa note de risque ESG par rapport à son univers investissable, démontrant ainsi une surperformance en termes de gestion du risque ESG.

iv. Après l'investissement, nous votons en nous appuyant les 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 entre les sexes non ajusté. Chaque année, le Fonds rend compte de ses données de vote et de ses résultats d'engagement afin de démontrer que ses votes sont alignés sur les principes de durabilité, ainsi que la manière dont il a voté sur des propositions relatives à des questions connexes, telles que le climat et les écarts de rémunération.

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 :

Oui. 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 la conformité aux principes du Pacte mondial des Nations unies, aux directives de l'OCDE pour les entreprises multinationales ainsi qu'aux Principes directeurs des Nations Unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme. Chaque année, le Fonds rend compte de son exposition à des sociétés non conformes aux normes ci-dessus.

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

Comme indiqué ci-dessus, le Fonds a pris en compte les PAI du Règlement européen sur la sécurité des données et d'autres critères ESG 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.

i. Le Fonds exclut les sociétés qui présentent les PAI suivantes : celles qui sont exposées à des armes illégales et 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 les émissions de GES ne sont pas conformes aux dispositions de l'Accord de Paris. En plus de ces PAI, le Fonds exclut également les sociétés dont le chiffre d'affaires est exposé à plus de 5 % aux activités suivantes : pétrole et gaz conventionnels, pétrole et gaz non conventionnels, armes conventionnelles, armes légères et tabac. Chaque année, le Fonds rend compte de son exposition à ces indicateurs.

ii. 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 la conformité aux principes du Pacte mondial des Nations unies et aux directives de l'OCDE pour les entreprises multinationales ainsi que les activités qui ont un effet défavorable sur la biodiversité. En outre, le Fonds exclut également les sociétés exposées à un niveau de risque élevé et grave de controverses ESG avec des perspectives négatives [qui n'ont pas une gestion des risques suffisante]. Chaque année, le Fonds rend compte de son exposition à des sociétés non conformes ou à celles exposées à des controverses ESG de niveau de risque élevé ou grave.

iii. 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 ; part de la consommation et de la production d'énergie non renouvelable ; écart de rémunération entre les sexes non ajusté. Chaque année, le Fonds rend compte de sa note de risque ESG par rapport à son univers investissable, démontrant ainsi une surperformance en termes de gestion du risque ESG.

iv. Après l'investissement, nous votons en nous appuyant les 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 entre les sexes non ajusté. Chaque année, le Fonds rend compte de ses données de vote et de ses résultats d'engagement afin de démontrer que ses votes sont alignés sur les principes de durabilité, ainsi que la manière dont il a voté sur des propositions relatives à des questions connexes, telles que le climat et les écarts de rémunération.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 31/12/2022

Investissements les plus importants	Secteur	% d'Actifs	Pays
API GROUP UN USD	Construction et Ingénierie	3,98 %	États-Unis
RENTOKIL LN GBp	Services environnementaux et Installations	3,65 %	Royaume-Uni
THERMO FISHER UN USD	Outils et Services des Sciences de la Vie	3,65 %	États-Unis
MSA SAFETY UN USD	Services et Fournitures de bureau	3,51 %	États-Unis
EQUINIX INC UW USD	SCPI spécialisées	3,46 %	États-Unis
FISERV INC UW USD	Traitement des données et services externalisés	3,28 %	États-Unis
CLEAN HARBORS UN USD	Services environnementaux et Installations	3,18 %	États-Unis
PALO ALTO UW USD	Logiciels de systèmes	3,04 %	États-Unis
EXPERIAN PLC LN GBp	Services de Recherche et de Conseil	2,94 %	Irlande
SPLUNK INC UW USD	Logiciel d'application	2,94 %	États-Unis
WABTEC CORP UN USD	Machines de construction et Camions lourds	2,89 %	États-Unis
CINTAS CORP UW USD	Services d'assistance diversifiés	2,81 %	États-Unis
HALMA PLC LN GBp	Équipements et Instruments électroniques	2,78 %	Royaume-Uni
NVENT UN USD	Composants et Équipements électriques	2,74 %	Royaume-Uni
AZENTA INC UW USD	Outils et Services des Sciences de la Vie	2,67 %	États-Unis

Le pays affiché est le pays à risque

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

Le Fonds s'est engagé à réaliser un minimum d'investissements durables de 90%. Au 31 décembre 2022, l'investissement réel était de 96,67%.

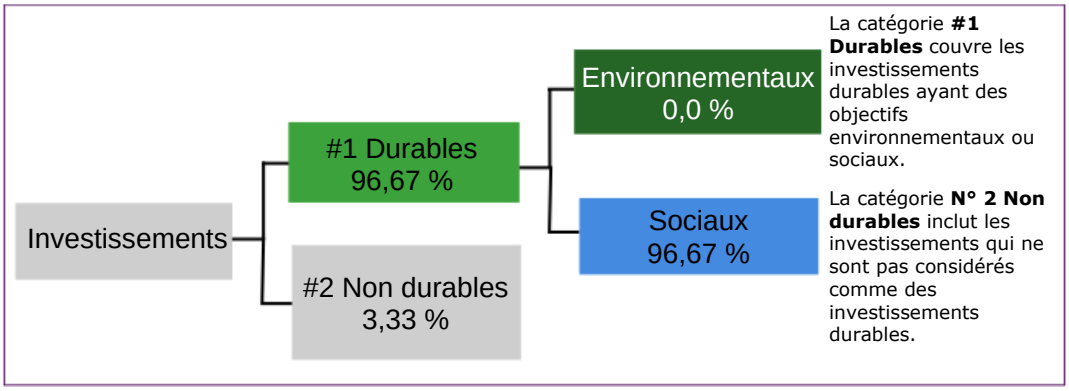
L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Investissements durables : 96,67 %

Liquidités : 3,33 %

Afin de se conformer à la taxonomie de l'UE, les critères pour les **gaz fossiles** incluent les



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

Le Fonds a investi dans tous les secteurs économiques à l'exception du secteur de l'énergie.

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

Sans objet

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées aux gaz fossiles et/ou à l'énergie nucléaire alignées sur la taxonomie de l'UE[1] ?

☐ Oui :

☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire

☒ Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui sont alignés sur la taxonomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxonomie, 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 deuxième graphique représente l'alignement sur la taxonomie uniquement par rapport aux

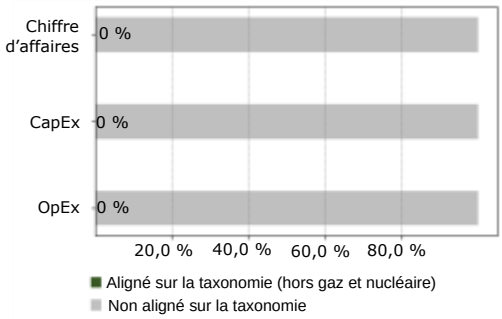
[1] Les activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire ne seront conformes à la Taxonomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne nuisent pas de manière significative aux objectifs de Taxonomie de l'UE (voir la note explicative dans la marge de gauche). Les critères complets pour les activités économiques liées aux gaz fossiles et à l'énergie nucléaire conformes à la Taxonomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

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 ;
- les **dépenses d'investissement** (CapEx) montrent les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, en faveur d'une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

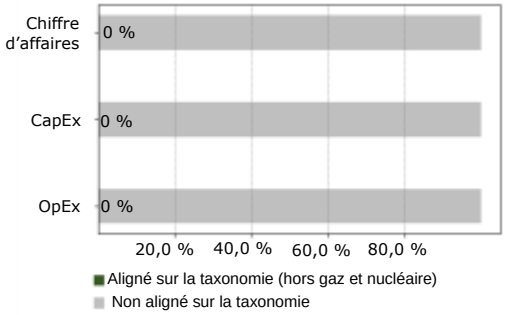
Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxonomie de l'UE.

investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

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



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



Ce graphique représente **100 %** du total des investissements.

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

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Sans objet

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxonomie de l'UE ?

Sans objet

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

96,67

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « non durables », quelle était leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Investissement en liquidités à des fins de gestion de la trésorerie. Cet investissement ne s'appuie sur aucune mesure de protection environnementale ou sociale minimale.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre l'objectif d'investissement durable au cours de la période de référence ?

Nous avons suivi la stratégie d'investissement :

1. Filtrage thématique durable

   Les Gestionnaires financiers ont sélectionné des titres :

- contribuant aux sous-segments du thème qui, à leur tour, contribuent à 1 ou plusieurs des objectifs de développement durable suivants : sécurité alimentaire et sanitaire, confidentialité des données et protection des consommateurs, accès amélioré et sécurisé à l'économie numérique, systèmes de transport et de mobilité sécurisés, systèmes de sécurité personnels et industriels et autres systèmes de sécurité avancés.
- qui ont répondu aux exigences de priorité ou de leadership des thèmes.
    - Priorité : l'émetteur doit générer au moins 20 % de ses revenus et/ou bénéfices à partir des produits concernés.
    - Exigences en matière de leadership : les produits de l'émetteur doivent, de l'avis des Gestionnaires financiers, être leaders du secteur, être innovants ou présenter un potentiel de disruption.

2. Exclusion basée sur l'activité

   Le Gestionnaire financier a exclu les titres exposés à des activités nuisibles et controversées, telles que le charbon, le pétrole et le gaz conventionnels, les armes non conventionnelles, etc. Pour plus d'informations, veuillez consulter notre politique d'exclusion à l'adresse suivante : https://www.thematics-am.com/en-FR/being-responsible/reports-and-publications.

3. Exclusion basée sur la conduite

   En outre, les Gestionnaires financiers ont systématiquement exclu 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 Gestionnaires financiers ont effectué des analyses ESG en appliquant leur méthode d'évaluation ESG exclusive, qui s'appuie 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 Gestionnaires financiers

attribuent une note aux sociétés individuelles sur 11 indicateurs environnementaux, sociaux et de gouvernance importants, en s'appuyant sur une gamme de ressources, notamment la recherche documentaire et l'engagement des entreprises auprès d'au moins deux agences de notation tierces (ISS et Sustainalytics). Le score ESG total, qui a eu le même coefficient (25 %) que les autres critères d'investissement (c'est-à-dire qualité, risque de négociation et gestion), a eu une incidence sur l'inclusion du titre et la pondération finale de l'investissement.

5. Le score ESG total, qui a eu le même coefficient (25 %) que les autres critères d'investissement (c'est-à-dire qualité, risque de négociation et gestion), a eu une incidence sur l'inclusion du titre et la pondération finale de l'investissement. La couverture a été supérieure à 90 %.
6. Les sociétés exposées à des controverses importantes avec des perspectives négatives et/ou graves ont été exclues. Aucune société n'était déjà dans le portefeuille et n'a été exposée à des controverses ESG importantes avec des perspectives négatives et/ou graves.
7. Les Gestionnaire financiers ont prévu d'exercer 100 % des droits de vote sur les émetteurs des titres détenus dans les portefeuilles gérés, conformément à sa politique de vote basée sur des principes de durabilité.
8. Les Gestionnaires financiers se sont engagés chaque année auprès d'un certain pourcentage d'émetteurs.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'Indice de Référence durable ?

Sans objet

Les Indices de Référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint l'objectif d'investissement durable.

- ***En quoi l'Indice de Référence différait-il d'un indice de marché large ?***

  Sans objet

- ***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 l'objectif d'investissement durable ?***

  Sans objet

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

  Sans objet

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

  Sans objet