ANNEXE IV

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:

Asset Management Model – Amazone Euro Fund

Identifiant d'entité juridique:

5493000PWJK54502XF48

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 n'établit 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.

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable?

●● ☐ **Oui**	●○ ☒ **Non**
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental:**___%	☐ 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
☐ 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 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	☐ 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 a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social:** ___%	☒ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

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

Conformément à l'article 8 du règlement (UE) 2019/2088, le compartiment promeut des caractéristiques sociales. A cette fin, les décisions d'investissement du compartiment sont prises sur la base des critères extra-financiers des entreprises, qui doivent répondre aux exigences de l'ISR (investissement socialement responsable).

Le compartiment se concentre en particulier sur les caractéristiques sociales suivantes des entreprises dans lesquelles il investit :

- La présence de femmes dans les comités exécutifs et dans les conseils d'administration
- Une forte proportion de femmes dans le management

Le compartiment n'atteindra pas les caractéristiques susmentionnées par le biais d'un indice de référence.

<u>Les caractéristiques sociales promues par le produit financier sont assurés :</u>

- ✓ soit analysant le management des sociétés,
- ✓ soit en investissant dans des titres financiers qui sont présents dans des indices d'investissement socialement responsable,
- ✓ soit dans des entreprises qui ont adhéré au pacte mondial des nations unies.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité?

L'indicateur de durabilité prévoit d'avoir au moins 90% des titres investis qui respectent les 3 points ci-dessus. En date du 30/12/2022, 100% des titres en portefeuilles respectaient ces critères (utilisés comme indicateurs de performance de la durabilité du produit financier). Veuillez noter que la limite de 90% s'applique seulement sur les titres investis et non sur la totalité des actifs du sous-fonds. Dès lors, le cash & provisions ne sont inclus dans le dénominateur.

...et par rapport aux périodes précédentes?

Comme indiqué dans les états financiers de l'année précédente, au cours de cette année, lors du processus de décision d'investissement, l'ancien gestionnaire (FERRIGESTION S.A.) avait vérifié l'existence de la mixité homme/femme au sein des comités exécutifs, au sein des conseils d'administration des entreprises dans lesquelles le produit financier était investi. Il avait surveillé toute modification de cette mixité dans chacun des investissements. Dès lors, l'indicateur de durabilité d'au moins 90% des titres investis (par rapport aux 3 points ci-dessus) devrait être respecté.

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?

N/A

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?

N/A

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

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

Cette section n'est pas applicable pour ce produit financier.

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:

Cette section n'est pas applicable pour ce produit financier.

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 s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

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 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?

Pas applicable.

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: les positions en début de mois de l'année 2022 ont été considérées et une moyenne a été calculée afin d'obtenir ce tableau.

/	Short Name	ISIN	% Assets	GICS Sector Name
1	WOLTERS KLUWER	NL0000395903	5.62%	Industrials
2	AIR LIQUIDE SA	FR0000120073	5.10%	Materials
3	CAPGEMINI SE	FR0000125338	4.79%	Information Technology
4	AXA	FR0000120628	4.67%	Financials
5	HERMES INTL	FR0000052292	4.26%	Consumer Discretionary
6	VISA INC-CLASS A	US92826C8394	4.19%	Financials
7	SCHNEIDER ELECTR	FR0000121972	4.15%	Industrials
8	L'OREAL	FR0000120321	4.04%	Consumer Staples
9	SAINT GOBAIN	FR0000125007	3.83%	Industrials
10	ORANGE	FR0000133308	3.81%	Communication Services
11	BNP PARIBAS	FR0000131104	3.72%	Financials
12	LEGRAND SA	FR0010307819	3.66%	Industrials
13	LVMH MOET HENNE	FR0000121014	3.48%	Consumer Discretionary
14	DANONE	FR0000120644	3.34%	Consumer Staples
15	ROCHE HLDG-GENUS	CH0012032048	3.22%	Health Care

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

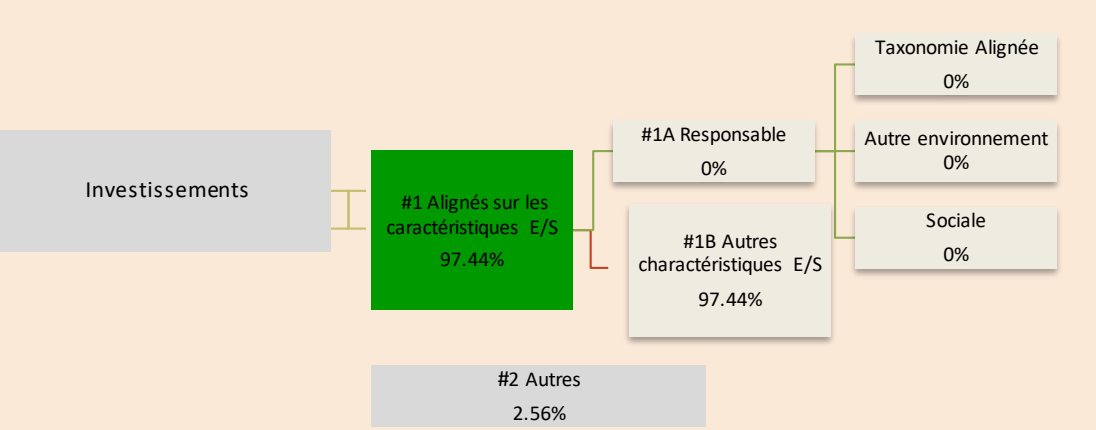
L'**allocation des actifs** décrit la part des investissements dans des actifs

En date du 30/12/2022, le portefeuille possède des investissements ayant des caractéristiques sociaux (ex : présence de femmes dans le comité exécutif) à hauteur de 97.44% (2.56% restant étant de la liquidité + provisions). Ce résultat a été obtenu en tenant en compte de tous les titres investis ayant des caractéristiques sociaux divisés en dénominateur par la valeur totale du sous-fonds (valeur nette d'inventaire qui inclue donc le cash).

Veuillez noter que le sous-fonds n'a pas d'investissement qui peuvent être considéré comme durable.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage:
- du **chiffre d'affaires** pour refléter le caractère écologique actuel des sociétés bénéficiaires des investissements;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, ce qui est pertinent pour une transition vers une économie verte;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

Quelle était l'allocation des actifs?



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 #2Autres inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont pas alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des comme des investissements durables.

La catégorie #1 Alignés sur les caractéristiques E/S :

SecurityType	SecurityName	PercentNAV
EQUITY Common stock	Wolters Kluwer NV	5.23%
EQUITY Common stock	AIR LIQUIDE	5.14%
EQUITY Common stock	BNP PARIBAS COMMON STOCK EUR2.	4.91%
EQUITY Common stock	HERMES INTERNATIONAL	4.81%
EQUITY Common stock	L OREAL	4.80%
EQUITY Common stock	SCHNEIDER ELECTRIC SA	4.44%
EQUITY Common stock	LEGRAND HOLDING ACT.PROV.OPO	4.30%
EQUITY Common stock	Engie SA	4.18%
EQUITY Common stock	AXA	4.11%
EQUITY Common stock	VISA INC -A	4.05%
EQUITY Common stock	ING GROEP	3.83%
EQUITY Common stock	CAP GEMINI SA	3.58%
EQUITY Common stock	ZURICH INSURANCE GROUP/NAM	3.46%
EQUITY Common stock	ACCENTURE PLC CL A COMMON STOCK USD.0022.5	3.27%
EQUITY Common stock	ORANGE SA	3.09%
EQUITY Common stock	ASTRAZENECA PLC	3.00%
EQUITY Common stock	ALLIANZ SE/NAM.VINKULIERT	2.99%
EQUITY Common stock	IPSOS SA	2.96%
EQUITY Common stock	PUBLICIS GROUPE COMMON STOCK EUR.4	2.93%
EQUITY Common stock	SAINT-GOBAIN	2.85%
EQUITY Common stock	AKZO NOBEL COMMON STOCK EUR2.	2.70%
EQUITY Common stock	KERING	2.60%
EQUITY Common stock	LVMH MOET VUITTON	2.42%
EQUITY Common stock	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.40%
EQUITY Common stock	KONINKLIJKE DSM NV	2.38%

EQUITY Common stock	ACCOR SA	2.31%
EQUITY Common stock	Société Générale SA	2.09%
FUND REIT (closed)	GECINA /ACT.NOM.	1.74%
EQUITY Common stock	TEMENOS GROUP AG /NAMEN.	1.10%
	Total	**97.67%**

Quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés?

Sector Level 1	Weight
Information Technology	7,9%
Consumer Discretionary	12,1%
Materials	10,2%
Financials	25,4%
Health Care	5,4%
Utilities	4,2%
Communication Services	9,0%
Consumer Staples	4,8%
Industrials	16,8%
Real Estate	1,7%
Cash	2,56%
Total	**100,0%**

Sector Level 2	Weight
Software & Services	7,9%
Consumer Services	2,3%
Materials	10,2%
Insurance	10,5%
Pharmaceuticals, Biotechnology	5,4%
Banks	10,8%
Utilities	4,2%
Consumer Durables & Apparel	9,8%
Media & Entertainment	5,9%
Household & Personal Products	4,8%
Capital Goods	11,6%
Telecommunication Services	3,1%
Financial Services	4,0%
Commercial & Professional Serv	5,2%
Equity Real Estate Investment	1,7%
Cash	2,56%
Total	**100,0%**

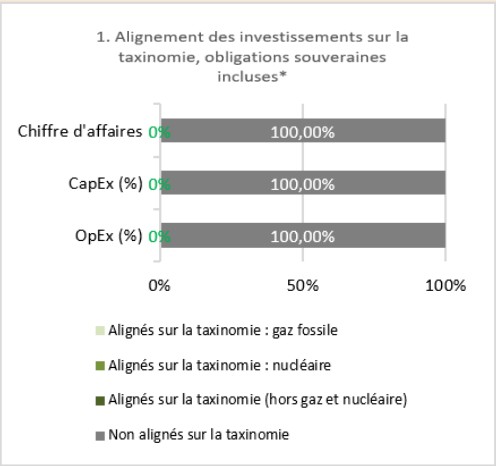
Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

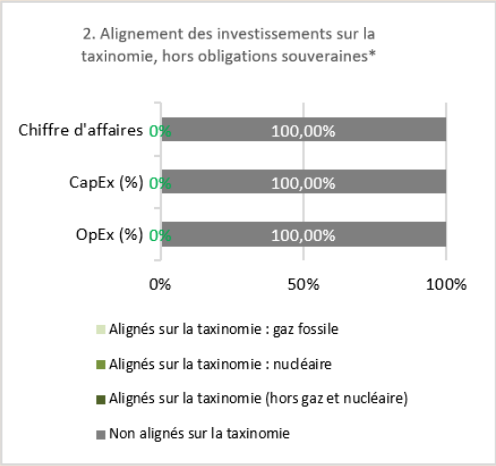
☐ Oui:

☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire

☒ Non

Les graphiques ci-dessous montrent en vert le pourcentage d'investissements qui était alignés sur la taxinomie de l'UE. Etant 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 de la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique montre l'alignement de la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.





Ce graphique représente 100% des investissements totaux

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

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

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

Pas applicable (0%).

Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes?

Pas applicable (0%).

Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020

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

Pas applicable (0%).

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

Pas applicable (0%).

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

En date du 30/12/2022, la catégorie « autres » était composée comme suit :

- des investissements ayant des caractéristiques sociaux (ex : présence de femmes dans le comité exécutif) à hauteur de 97.44%
- 2.56% restant étant de la liquidité + provisions.

Ce résultat a été obtenu en tenant en compte de tous les titres investis ayant des caractéristiques sociaux divisés en dénominateur par la valeur totale du sous-fonds (valeur nette d'inventaire qui inclue donc le cash).

Veuillez noter que le sous-fonds n'a pas d'investissements qui peuvent être considérés comme durables.

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

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

Les caractéristiques sociales promues par le produit financier ont été respectées:

- ✓ soit analysant le management des sociétés (au moins 30% de femmes dans les organes de direction (comités exécutifs et conseil d'administration),
- ✓ soit en investissant dans des titres financiers qui sont présents dans des indices d'investissement socialement responsable,
- ✓ soit dans des entreprises qui ont adhéré au pacte mondial des nations unies.

Veuillez noter que le sous-fonds n'a pas d'investissements qui peuvent être considérés comme durables.

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

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

  Pas 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?***

  Pas applicable.

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

  Pas applicable.

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

  Pas applicable.