ANNEXE II

Modèle d'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

EDMOND DE ROTHSCHILD FUND - BIG DATA

Dénomination du produit :
Edmond de Rothschild Fund Big Data

Identifiant d'entité juridique :
549300IWBX1JC2L8IP43

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 comprend 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 a-t-il un objectif d'investissement durable?

☐ **Oui**

☐ Il réalisera un minimum 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

☐ 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 :** ___%

☒ **Non**

☒ 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 20% 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 Compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales identifiées par notre cadre ESG, telles que :

- Environnementales : stratégie environnementale, consommation d'énergie, émissions de gaz à effet de serre, eau, déchets, pollution, impact écologique ;
- Sociales : conditions de travail, gestion des ressources humaines, impact social, relations avec les parties prenantes, santé et sécurité.

Aucun indice de référence n'a été désigné dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales.

Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont 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 ?

Les gérants ont accès à des outils de surveillance des portefeuilles, fournissant des indicateurs climatiques et ESG, tels que l'empreinte CO2 ou la température du portefeuille, l'exposition aux différents Objectifs de développement durable des Nations Unies (ODD), ainsi que les notations environnementales et sociales des investissements. Nos outils permettent une vue consolidée du portefeuille ainsi qu'une analyse émetteur par émetteur. Notre analyse ESG exclusive et/ou provenant de sources externes attribue également une note à chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment et mises à la disposition des gérants.

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?

Les investissements durables du fonds visent à contribuer positivement à un ou plusieurs Objectifs de développement durable des Nations Unies (ODD), dans les domaines environnemental, social ou sociétal, sans causer de préjudice important et en respectant les normes minimales de gouvernance.

La description de la méthodologie d'investissement durable définie par Edmond de Rothschild Asset Management (France) est disponible sur le site Internet de la société de gestion d'actifs : : https://www.edmond-de-rothschild.com/SiteCollectionDocuments/Responsible-investment/OUR%20ENGAGEMENT/FR/EdRAM-Definition-et-methodologie-Investissement-durable.pdf

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 ?

Les investissements durables réalisés par le Compartiment garantissent qu'ils ne causent pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable, notamment :

- en appliquant la politique d'exclusion d'Edmond de Rothschild Asset Management (France) qui inclut les armes controversées, le tabac, le charbon thermique et les énergies fossiles non conventionnelles ;

- en garantissant qu'il n'investit pas dans des sociétés contreviennent au Pacte mondial des Nations Unies.

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

Les indicateurs concernant les incidences négatives sont intégrés dans le processus d'investissement du fonds et font également partie de notre modèle de notation ESG et de notre définition de l'investissement durable (voir la description de la méthodologie d'investissement durable disponible sur le site Internet). Ils sont intégrés dans les outils de surveillance des portefeuilles et suivis par l'Équipe d'investissement et le Département des risques.

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 :

Les gérants sélectionnent les investissements durables conformément 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, en excluant toute entreprise qui contrevient aux principes du Pacte mondial des Nations Unies.

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?

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.

X Oui,

Le Compartiment prend en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité en appliquant d'abord la politique d'exclusion d'Edmond de Rothschild Asset Management (France), notamment en ce qui concerne le charbon thermique et les armes controversées. Les principales incidences négatives sont également prises en compte dans le cadre de l'analyse ESG exclusive ou externe des émetteurs et ont un impact sur les notes environnementales et sociales ainsi que sur la note ESG globale.

Les rapports périodiques du Compartiment présentant, conformément à l'article 11 du règlement (UE) 2019/2088, dit Règlement SFDR, notamment le degré de respect des caractéristiques environnementales ou sociales, sont disponibles sur le site Internet www.edmond-de-rothschild.com sous l'onglet « Fund Center ».

Non

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

L'objectif de la stratégie ESG du compartiment consiste à identifier les opportunités d'investissement en identifiant les sociétés ayant un impact environnemental ou social positif et une bonne performance extra-financière. Il vise également à détecter les risques extra-financiers qui pourraient se matérialiser d'un point de vue financier.

À cette fin, le compartiment s'appuie sur une notation ESG interne ou sur une notation fournie par une agence de notation externe, combinée à un filtrage négatif basé sur une liste d'exclusion définie par la société de gestion, disponible sur son site Internet.

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

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?

Au moins 90 % des sociétés du portefeuille disposent d'une notation ESG. Il s'agira soit d'une notation ESG exclusive, soit d'une notation fournie par une agence de notation extra-financière externe. À l'issue de ce processus, le Compartiment bénéficiera d'une notation ESG supérieure à celle de son univers d'investissement.
Le processus de sélection des titres comprend un filtrage négatif, en vertu duquel le Gestionnaire d'investissement a mis en place une politique d'exclusion formelle qui exclut les sociétés controversées liées aux armes, au charbon, au tabac et aux énergies fossiles non conventionnelles.

Pour plus d'informations, consultez le site Internet du Gestionnaire d'investissement : https://www.edmond-de-rothschild.com/en/Pages/Responsible-investment.aspx

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

  Le Compartiment ne s'engage pas à un taux minimum pour réduire la portée des investissements envisagés avant la mise en œuvre de la stratégie d'investissement.

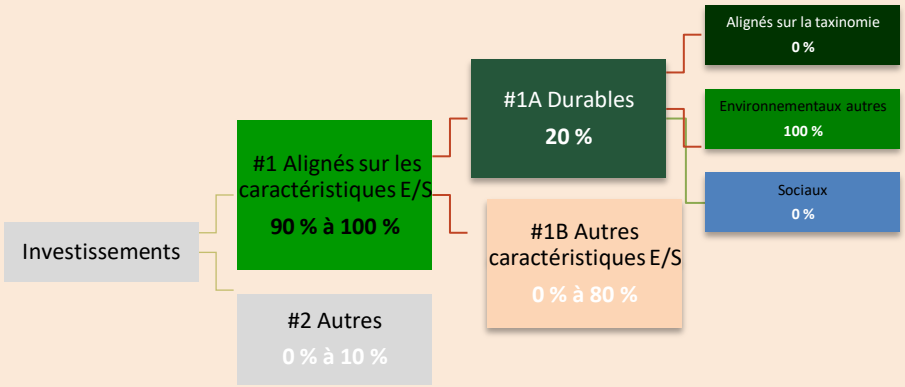
Les pratiques de **bonne gouvernance** concernent des structures de gestion saines, les relations avec le personnel, la rémunération du personnel et le respect des obligations fiscales.

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

  Les pratiques de bonne gouvernance sont évaluées par une analyse complète du pilier de gouvernance dans l'analyse ESG de l'émetteur, ainsi que par la prise en compte des controverses affectant l'émetteur. Une note de gouvernance minimale, fournie par notre analyse ESG interne ou par un fournisseur externe, est appliquée aux investissements durables du Compartiment.

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

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



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 minimums 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.

- ***Comment l'utilisation de produits dérivés permet-elle d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier*** **?**

  Les instruments dérivés à désignation unique avec exposition longue uniquement (y compris les options, les contrats à terme standardisés, les

swaps sur défaut de crédit, les contrats sur la différence, etc.) sont inclus aux fins des méthodologies d'analyse ESG exclusives et de calcul de la part d'investissement durable du Compartiment conformément au Règlement SFDR.
Les effets de l'exposition et de la couverture au même sous-jacent à partir de produits dérivés à désignation unique seront compensés

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

Étant donné qu'il n'est actuellement pas en mesure de fournir des données fiables pour évaluer la part de ses investissements qui sont éligibles au règlement sur la taxinomie de l'UE ou alignés sur celui-ci, à ce stade, le Compartiment n'est pas en mesure de calculer entièrement et précisément les investissements sous-jacents qui sont qualifiés de durables sur le plan environnemental sous la forme d'un pourcentage d'alignement minimum conformément à une interprétation stricte de l'article 3 du règlement sur la taxinomie de l'UE. Actuellement, le Compartiment ne vise pas à réaliser des investissements qui contribuent à des objectifs environnementaux axés sur l'atténuation du changement climatique et/ou l'adaptation au changement climatique, ou sur tout autre objectif environnemental au sens du règlement sur la taxinomie de l'UE. Par conséquent, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE est actuellement de 0 %.

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'UE[15]?

☐ Oui :

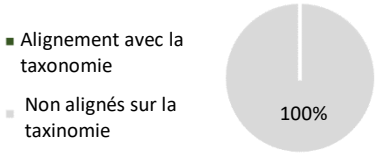
☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire

☒ Non

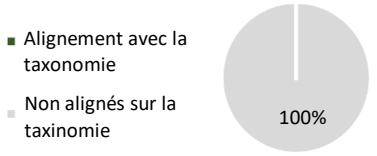
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement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

[15] 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 (UE) 2022/1214 de la Commission.

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 ?

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 seuil minimum pour la part des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE est de 20 %.

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

Sans objet.

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

La catégorie « #2 Autres » inclut : Les investissements à des fins de couverture et les liquidités détenues à titre accessoire

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 ?

Aucun indice de référence n'a été désigné dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales.

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

Sans objet.

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

Sans objet.

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

  Sans objet.

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

  Sans objet.

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.edmond-de-rothschild.com/fr/asset-management/sustainability-in-action

https://funds.edram.com/funds-list