

OFI INVEST ESG MID CAPS EURO

Annexe d'informations périodiques SFDR sur
l'exercice clos le 30 janvier 2026



ofi invest
Asset Management

Annexe 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 :
Ofi Invest ESG Mid Caps Euro

Identifiant d'entité juridique :
969500FFZ0BP6WNHY845

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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 pas de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi 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 économique durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



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

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

Oui

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 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 a réalisé un minimum d'**investissements durables ayant un objectif social** : ____ %

Non

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas eu d'objectifs d'investissement durable, il présentait une proportion de **71,45%** 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 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 ?

Ofi Invest ESG Mid Caps Euro (ci-après le « **Fonds** ») fait la promotion des caractéristiques environnementales et sociales grâce à une méthodologie de notation ESG propriétaire et, bien qu'il n'ait pas eu d'objectifs d'investissement durable, il présentait une proportion de **71,45 %** d'investissements durables au 30 janvier 2026.

En effet, afin d'évaluer les pratiques environnementales, sociales et de gouvernance des émetteurs, la Société de gestion s'appuie sur la méthodologie de notation ESG interne.

Les thèmes pris en compte dans la revue des bonnes pratiques ESG sont :

- Environnement : Changement climatique - Ressources naturelles - Financement de projets - Rejets toxiques - Produits verts.
- Social : Capital humain - Sociétal - Produits et services – Communautés et droits humain
- Gouvernance : Structure de gouvernance – Comportement sur les marchés

Le Fonds met en œuvre une approche ESG en "amélioration de note", qui consiste à obtenir une note ESG moyenne du Fonds, supérieure à la note ESG moyenne de l'univers ISR de comparaison, comprenant les valeurs composant l'indice Euro Stoxx Total Market Index (BKXE) après élimination de 20% des valeurs les moins bien notées.

L'univers ISR de comparaison est cohérent avec l'indicateur de référence du Fonds

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

Le Fonds a changé de méthodologie ESG le 1^{er} janvier 2025 et a été délabélisé.

Au 30 janvier 2026, les performances des indicateurs de durabilité permettant de mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales et sociales du Fonds sont les suivantes :

- **La note ESG moyenne du Fonds** après élimination de 20% des valeurs les moins bien notées : La note ESG moyenne du Fonds a atteint **6,74 sur 10** ;
- **La note ESG moyenne de l'univers ISR du Fonds** après élimination de 20% des valeurs les moins bien notées : La note ESG moyenne de l'univers ISR du Fonds était de **6,59 sur 10** ;
- **La part d'investissement durable du Fonds** : Le Fonds a investi **71,45** % de son actif net dans des titres répondant à la définition de l'investissement durable d'Ofi Invest AM.

Conformément à la mise en œuvre des Orientations de l'ESMA, le Fonds applique les exclusions PAB, résumées dans notre « Politique d'investissement – Exclusions sectorielles et normatives ». Ce document est disponible à l'adresse suivante : https://www.ofi-invest-am.com/pdf/principes-et-politiques/politique-exclusions-sectorielles-et-normatives_ofi-invest-AM.pdf.

Le suivi des indicateurs, mentionnés précédemment, dans les outils de gestion permet d'affirmer qu'il n'y a pas eu de variations significatives des performances des indicateurs tout au long de la période de reporting considérée, entre le 1^{er} février 2025 et 30 janvier 2026.

Pour plus d'informations sur ces indicateurs de durabilité et leur méthode de calcul, veuillez-vous référer au prospectus et à l'annexe précontractuelle du Fonds.

● *... et par rapport aux périodes précédentes ?*

Au 31 janvier 2025, les performances des indicateurs de durabilité permettant de mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales et sociales du Fonds sont les suivantes :

- La note ESG moyenne du Fonds après élimination de 20% des valeurs les moins bien notées : La note ESG moyenne du Fonds a atteint 6,66 sur 10 ;
- La note ESG moyenne de l'univers ISR du Fonds après élimination de 20% des valeurs les moins bien notées : La note ESG moyenne de l'univers ISR du Fonds était de 6,38 sur 10 ;
- La part d'investissement durable du Fonds : Le Fonds a investi 75% de son actif net dans des titres répondant à la définition de l'investissement durable d'Ofi Invest AM.

Le suivi des indicateurs, mentionnés précédemment, dans les outils de gestion permet d'affirmer qu'il n'y a pas eu de variations significatives des performances des indicateurs tout au long de la période de reporting considérée, entre le 1^{er} février 2024 et 31 janvier 2025.

Au 31 janvier 2024, les performances des indicateurs de durabilité permettant de mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales et sociales du Fonds ont été les suivantes :

- Le score ESG au niveau du portefeuille a atteint 7,62 sur 10 et le score ESG de son indicateur de référence était de 6,81 sur 10 ;
- Le pourcentage d'entreprises les moins performantes en ESG exclues selon l'approche Best-in-Class : 20%

En outre, dans le cadre du Label ISR attribué au Fonds, les deux indicateurs ESG suivants promouvant des caractéristiques sociales et environnementales ont été pilotés au niveau du Compartiment et de son univers ISR. Leurs performances respectives au 31 janvier 2024 sont les suivantes :

- L'intensité carbone : l'intensité carbone représente 64,41 tonnes d'émissions de CO2 équivalent par million de dollars de chiffre d'affaires par rapport à son univers ISR dont l'intensité carbone représente 145,61 tonnes d'émissions de CO2 équivalent par million de dollars de chiffre d'affaires;
- La part d'administrateurs indépendants au sein des conseils d'administration: la part des administrateurs au sein des conseils d'administration est de 0,95% par rapport à son univers dont la part est de 0,93%.

Le suivi des indicateurs, mentionnés précédemment, dans les outils de gestion permet d'affirmer qu'il n'y a pas eu de variations significatives des performances des indicateurs tout au long de la période de reporting considérée, entre le 1er février 2023 et 31 janvier 2024.

Au **31 janvier 2023**, les performances des indicateurs de durabilité permettant de mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales et sociales du Fonds ont été les suivantes :

- Le score ESG au niveau du portefeuille a atteint 7,17 sur 10 et le score ESG de son indicateur de référence était de 6,61 sur 10 ;
- Le pourcentage d'entreprises les moins performantes en ESG exclues selon l'approche Best-in-Class : 20%

De plus, dans le cadre du Label ISR attribué au Fonds, un indicateur ESG correspondant aux caractéristiques sociales et environnementales promues a été particulièrement suivi. Sa performances respective au 31 janvier 2023 a été la suivante :

- L'intensité carbone a représenté 114,75 tonnes d'émissions de CO2 équivalent par million de dollars de chiffre d'affaires par rapport à son univers ISR dont l'intensité carbone a représenté 142,09 tonnes d'émissions de CO2 équivalent par million de dollars de chiffre d'affaires.

Le suivi des indicateurs, mentionnés précédemment, dans les outils de gestion permet d'affirmer qu'il n'y a pas eu de variations significatives des performances des indicateurs tout au long de la période de reporting considérée, entre le 1er février 2023 et le 31 janvier 2024.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Le Fonds s'engageait à détenir au minimum 20% de son actif net dans des titres répondant à la définition d'investissement durable d'Ofi Invest AM.

Au **30 janvier 2026**, comme indiqué ci-dessus le Fonds détient **71,45 %**, en actif net, d'émetteurs contribuant à un objectif d'investissement durable.

Ceci implique donc que ces émetteurs :

- Ont contribué de manière positive ou apporté un bénéfice pour l'environnement et/ou la société ;
- N'ont pas causé de préjudice important ;
- Et ont disposé d'une bonne gouvernance.

L'ensemble des filtres et indicateurs utilisés afin de définir un investissement durable est détaillé dans notre politique d'investissement responsable, disponible sur notre site Internet à l'adresse suivante : <https://www.ofi-invest-am.com/pdf/principes-et-politiques/politiqueinvestissement-responsable.pdf>

Ces filtres sont paramétrés dans notre outil de gestion et assurés grâce à la mise à disposition des indicateurs ESG nécessaires.

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.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

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

Afin de nous assurer que les émetteurs sous revue n'ont pas causé de préjudice important (Do Not Significantly Harm – DNSH) en matière de durabilité, Ofi Invest AM a vérifié que ces émetteurs :

- N'étaient pas exposés aux Indicateurs d'Incidences Négatives (PAI) : 4, 10 et 14
- N'étaient pas exposés à des activités controversées ou jugées sensibles en matière de durabilité
- N'ont pas fait l'objet de controverses dont le niveau de sévérité est jugé très élevé

Ces filtres sont paramétrés dans notre outil de gestion et assurés grâce à la mise à disposition des indicateurs ESG nécessaires.

- 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 :

Afin de nous assurer que les émetteurs définis comme investissement durable détenus dans le Fonds soient conformes aux principes de l'OCDE et aux principes directeurs des Nations Unies, Ofi Invest AM a veillé à ce que ces émetteurs :

- Ne soient pas exposés à des activités liées à de typologies d'armes controversées, telles que les bombes à sous munitions ou mines antipersonnel, armes biologiques, armes chimiques... (PAI 14) ;
- Ne violent pas les principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE (PAI 10).

Ces filtres sont paramétrés dans notre outil de gestion et assurés grâce à la mise à disposition des indicateurs ESG nécessaires.

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 ?

Les méthodes d'évaluation par la Société de Gestion des sociétés investies sur chacune des principales incidences négatives liées aux facteurs de durabilité sont les suivantes :

Indicateur d'incidence négative	Elément de mesure	Incidences [année n]	Incidences [année n-1]	Explication	Mesures prises, mesures prévues et cibles définies pour la période de référence suivante	
Indicateurs climatiques et autres indicateurs liés à l'environnement						
Emissions de gaz à effet de serre	1. Emissions de GES	Emissions de GES de niveau 1	4413,11 Teq CO2	2936,42 Teq CO2	Se référer à la « Déclaration Relative aux principales incidences négatives des politiques d'investissement sur les facteurs de durabilité » disponible sur le site internet de la Société de gestion	Livraison des outils à la gestion pour piloter la trajectoire climat pour chaque portefeuille Mise en place d'un score de crédibilité des plans de transition afin de venir corriger la trajectoire déclarée. Convergence des indicateurs de suivis ESG des fonds sur des indicateurs d'incidences négatives (PAI).
			Taux de couverture = 98,72 %	Taux de couverture = 100 %		
		Emissions de GES de niveau 2	1623,25 Teq CO2	1971,93 Teq CO2		
			Taux de couverture = 98,72 %	Taux de couverture = 100 %		
		Emissions de GES de niveau 3	45570,56 Teq CO2	67991,35 Teq CO2		
	Taux de couverture = 98,72 %	Taux de couverture = 100 %				
	Emissions totales de GES	51606,93(Teq CO2)	72899,69 (Teq CO2)			

			Taux de couverture = 98,72%	Taux de couverture = 100 %		
	2. Empreinte carbone	Empreinte carbone (Émissions de GES de niveaux 1, 2 et 3 / EVIC)	506,75 (Teq CO2/million d'EUR)	726,20 (Teq CO2/million d'EUR)	Se référer à la « Déclaration Relative aux principales incidences négatives des politiques d'investissement sur les facteurs de durabilité » disponible sur le site internet de la Société de gestion	Convergence des indicateurs de suivis ESG des fonds sur des indicateurs d'incidences négatives (PAI).
			Taux de couverture = 98,72 %	Taux de couverture = 100 %		
	3. Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements	Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements (Émissions de GES de niveaux 1, 2 et 3 / CA)	794,14 (Teq CO2/million d'EUR)	948,59 (Teq CO2/million d'EUR)	Se référer à la « Déclaration Relative aux principales incidences négatives des politiques d'investissement sur les facteurs de durabilité » disponible sur le site internet de la Société de gestion	Convergence des indicateurs de suivis ESG des fonds sur des indicateurs d'incidences négatives (PAI).
			Taux de couverture = 98,72 %	Taux de couverture = 100 %		
	4. Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles	Part d'investissement dans des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles	3,86%	0,05%	Se référer à la « Déclaration Relative aux principales incidences négatives des politiques d'investissement sur les facteurs de durabilité » disponible sur le site internet de la Société de gestion	Convergence des indicateurs de suivis ESG des fonds sur des indicateurs d'incidences négatives (PAI).
			Taux de couverture = 98,11%	Taux de couverture = 100%		
	5. Part de consommation et de production d'énergie non renouvelable	Part de la consommation et de la production d'énergie des sociétés bénéficiaires des investissements qui provient de sources d'énergie non renouvelables, par rapport à celle provenant de sources d'énergie renouvelables, exprimées en pourcentage du total des ressources d'énergie	Part d'énergie non renouvelable consommée = 57,97%	Part d'énergie non renouvelable consommée = 0,60%	Se référer à la « Déclaration Relative aux principales incidences négatives des politiques d'investissement sur les facteurs de durabilité » disponible sur le site internet de la Société de gestion	Convergence des indicateurs de suivis ESG des fonds sur des indicateurs d'incidences négatives (PAI).
			Taux de couverture = 97,61%	Taux de couverture = 98,20%		
			Part d'énergie non-renouvelable produite = 12,62 %	Part d'énergie non-renouvelable produite = 0,29%		
			Taux de couverture = 47,86%	Taux de couverture = 25,28%		
	6. Intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique	Consommation d'énergie en GWh par million d'euros de chiffre d'affaires des sociétés bénéficiaires d'investissements, par secteur à fort impact climatique	0,31 (GWh/million d'EUR)	0,37 (GWh/million d'EUR)	Se référer à la « Déclaration Relative aux principales incidences négatives des politiques d'investissement sur les facteurs de durabilité » disponible sur le site internet de la Société de gestion	Convergence des indicateurs de suivis ESG des fonds sur des indicateurs d'incidences négatives (PAI).
			Taux de couverture = 98,72%	Taux de couverture = 98,91%		
Biodiversité	7. Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité	Part des investissements effectués dans des sociétés ayant des sites/établissements situés dans ou à proximité de zones sensibles sur le plan de la biodiversité, si les activités de ces sociétés ont une incidence négative sur ces zones	1,22%	0,01%	Se référer à la « Déclaration Relative aux principales incidences négatives des politiques d'investissement sur les facteurs de durabilité » disponible sur le site internet de la Société de gestion	Convergence des indicateurs de suivis ESG des fonds sur des indicateurs d'incidences négatives (PAI). Poursuite de la campagne d'engagement sur les biocides et produits chimiques dangereux.
			Taux de couverture = 94,01%	Taux de couverture = 94,55%		
Eau	8. Rejets dans l'eau	Tonnes de rejets dans l'eau provenant des sociétés bénéficiaires d'investissements, par million d'euros investis, en moyenne pondérée	85878,55 T/million d'EUR CA	192605,72 T/million d'EUR CA	Se référer à la « Déclaration Relative aux principales incidences négatives des politiques d'investissement sur les facteurs de durabilité » disponible sur le site internet de la Société de gestion.	Convergence des indicateurs de suivis ESG des fonds sur des indicateurs d'incidences négatives (PAI).
			Taux de couverture = 7,81	Taux de couverture = 9,07		
Déchets	9. Ratio de déchets dangereux et de déchets radioactifs	Tonnes de déchets dangereux et de déchets radioactifs produites par les sociétés bénéficiaires d'investissements, par million d'euros	81,83 (Tonnes)	95,22 (Tonnes)	Se référer à la « Déclaration Relative aux principales incidences négatives des politiques d'investissement sur les facteurs de durabilité » disponible sur le site internet de la Société de gestion.	Convergence des indicateurs de suivis ESG des fonds sur des indicateurs d'incidences négatives (PAI).
			Taux de couverture = 63,64 %	Taux de couverture = 58,59%		

		investi, en moyenne pondérée					
Indicateurs liés aux questions sociales, de personnel, de respect des droits de l'homme et de lutte contre la corruption et les actes de corruption							
Les questions sociales et de personnel	10. Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales	Part d'investissement dans des sociétés qui ont participé à des violations des principes du Pacte mondial des Nations unies ou des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales	0%	0%	Se référer à la « Déclaration Relative aux principales incidences négatives des politiques d'investissement sur les facteurs de durabilité » disponible sur le site internet de la Société de gestion.	Convergence des indicateurs de suivis ESG des fonds sur des indicateurs d'incidences négatives (PAI).	
			Taux de couverture = 99,48%	Taux de couverture = 100%			
	11. Absence de processus et de mécanismes de conformité permettant de contrôler le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies et de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales	Part d'investissement dans des sociétés qui n'ont pas de politique de contrôle du respect des principes du Pacte mondial des Nations unies ou des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales, ni de mécanismes de traitement des plaintes ou des différends permettant de remédier à de telles violations	0,35 %	0,35 %	Se référer la « Déclaration Relative aux principales incidences négatives des politiques d'investissement sur les facteurs de durabilité » disponible sur le site internet de la Société de gestion.	Convergence des indicateurs de suivis ESG des fonds sur des indicateurs d'incidences négatives (PAI).	
			Taux de couverture = 93,90 %	Taux de couverture = 95,43 %			
	12. Écart de rémunération entre hommes et femmes non corrigé	Écart de rémunération moyen non corrigé entre les hommes et les femmes au sein des sociétés bénéficiaires des investissements	0,14	0,17	Se référer la « Déclaration Relative aux principales incidences négatives des politiques d'investissement sur les facteurs de durabilité » disponible sur le site internet de la Société de gestion.	Convergence des indicateurs de suivis ESG des fonds sur des indicateurs d'incidences négatives (PAI).	
			Taux de couverture = 47,14%	Taux de couverture = 47,54 %			
	13. Mixité au sein des organes de gouvernance	Ratio femmes/hommes moyen dans les organes de gouvernance des sociétés concernées, en pourcentage du nombre total de membres	37,93 %	0,40%	Se référer la « Déclaration Relative aux principales incidences négatives des politiques d'investissement sur les facteurs de durabilité » disponible sur le site internet de la Société de gestion.	Convergence des indicateurs de suivis ESG des fonds sur des indicateurs d'incidences négatives (PAI).	
			Taux de couverture = 99,48%	Taux de couverture = 100%			
	14. Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	Part d'investissement dans des sociétés qui participent à la fabrication ou à la vente d'armes controversées	0%	0%	Se référer la « Déclaration Relative aux principales incidences négatives des politiques d'investissement sur les facteurs de durabilité » disponible sur le site internet de la Société de gestion.	Convergence des indicateurs de suivis ESG des fonds sur des indicateurs d'incidences négatives (PAI).	
			Taux de couverture = 99,68%	Taux de couverture = 100%			
	Indicateurs supplémentaires liés aux questions sociales et environnementales						
	Eau, déchets et autres matières	Investissements dans des sociétés productrices de produits chimiques	Part d'investissement dans des entreprises produisant des produits chimiques	6,34 %	0%	Se référer la « Déclaration Relative aux principales incidences négatives des politiques d'investissement sur les facteurs de durabilité » disponible sur le site internet de la Société de gestion.	Convergence des indicateurs de suivis ESG des fonds sur des indicateurs d'incidences négatives (PAI).
				Taux de couverture = 95,94%	Taux de couverture = 100%		
	Lutte contre la corruption et les	Insuffisance des mesures prises pour remédier au non-respect de normes de	Part d'investissement dans des entités n'ayant pas pris de	3,74%	0,03%	Se référer la « Déclaration Relative aux principales incidences négatives des politiques d'investissement sur les facteurs de durabilité » disponible sur le site internet de la Société de gestion.	Convergence des indicateurs de suivis ESG des fonds sur des

actes de corruption	lutte contre la corruption et les actes de corruption	mesures suffisantes pour remédier au non-respect de normes de lutte contre la corruption et les actes de corruption	Taux de couverture = 95,64%	Taux de couverture = 95,26%	de la Société de gestion	indicateurs d'incidences négatives (PAI).
---------------------	---	---	-----------------------------	-----------------------------	--------------------------	---

Pour plus d'information, veuillez-vous référer à la « Déclaration relative aux Principales Incidences Négatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité » disponible sur le site Internet de la Société de Gestion : <https://www.ofi-invest-am.com/finance-durable>.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Au 30 janvier 2026, les principaux investissements du Fonds sont les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
PRYSMIAN	Industriel	4,18%	Italie
PUBLICIS GROUPE SA	Communication Services	3,55%	France
KONINKLIJKE KPN NV	Communication Services	3,30%	Pays-Bas
FRESENIUS SE AND CO KGAA	Soins de santé	2,64%	Allemagne
KERRY GROUP PLC	Produits de consommation de base	2,62%	Irlande
TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE	Services publics	2,31%	Italie
NN GROUP NV	Finances	2,29%	Pays-Bas
WARTSILA	Industriel	2,24%	Finlande
ACCOR SA	Consommation discrétionnaire	1,82%	France
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	Industriel	1,81%	Allemagne
ALSTOM SA	Industriel	1,77%	France
BPER BANCA	Finances	1,70%	Italie
OFI INVEST ESG LIQUIDITES I		1,69%	France
TECHNIP ENERGIES NV	Énergie	1,68%	France
ASR NEDERLAND NV	Finances	1,68%	Pays-Bas

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



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

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

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 30 janvier 2026, le Fonds a **98,22 %** de son actif net constitué d'investissements contribuant à la promotion des caractéristiques environnementales et sociales (#1 Alignés avec les caractéristiques E/S).

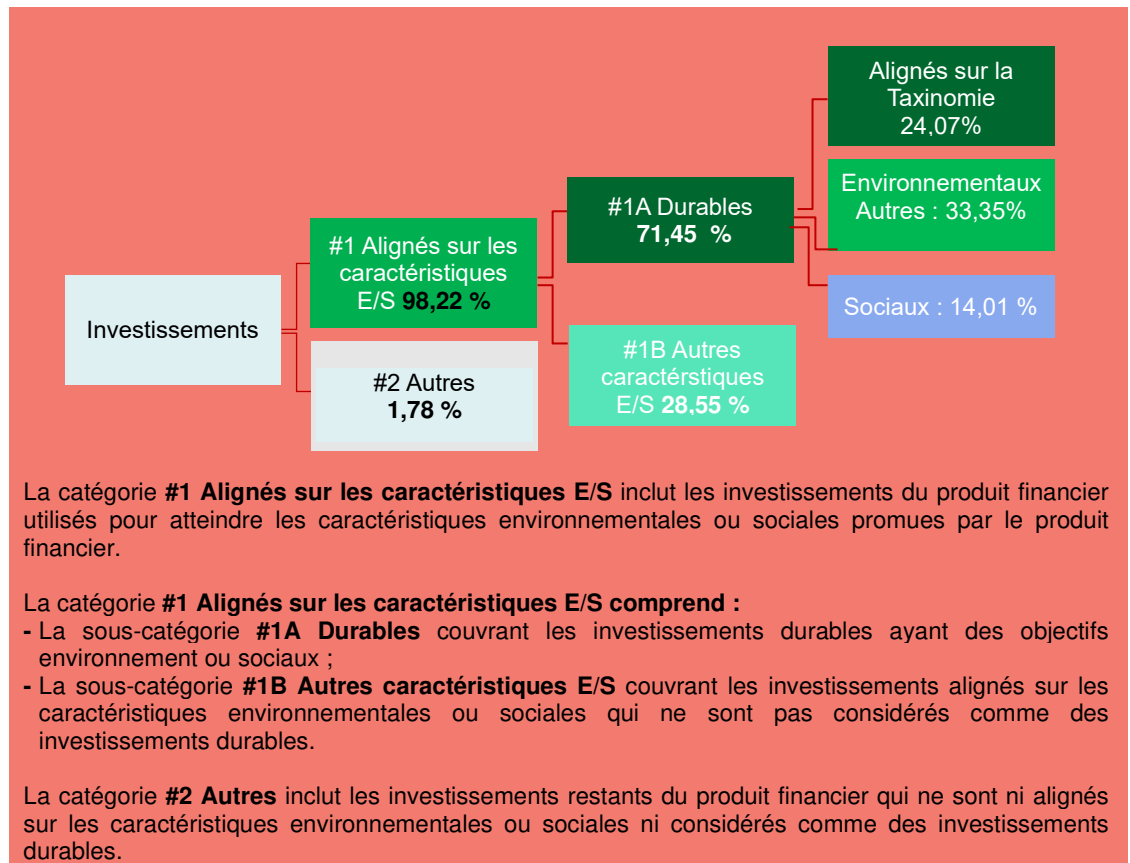
Le Fonds a **1,78 %** de son actif net appartenant à la poche #2 Autres. Celle-ci est constituée de :

- **0,50 %** de liquidités ;
- **0 %** de dérivés ;
- **1,28 %** de valeurs ou des titres en portefeuille ne disposant pas d'un score ESG.

Le Fonds a **71,45 %** de son actif net appartenant à la poche #1A Durables.

Le Fonds a donc respecté l'allocation d'actifs prévue :

- Un minimum de 80% de l'actif net du fonds appartenant à la poche #1 Alignés avec les caractéristiques E/S ;
- Un maximum de 20% des investissements appartenant à la poche #2 Autres, dont 10% maximum de valeurs ou de titres ne disposant pas d'un score ESG et 10% maximum liquidités et de produits dérivés.
- Un minimum de 20% de l'actif net du fonds appartenant à la poche #1A Durable.



Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et gestion des déchets.

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 ?

Au 30 janvier 2026, la décomposition sectorielle des actifs investis est la suivante :

Secteurs	Sous secteurs	poids
Industriel		27,70%
Industriel	Machines	12,00%
Industriel	Équipements électriques	5,50%
Industriel	Aérospatiale et Défense	4,00%
Industriel	Comp. et Distribution de Transactions	2,00%
Industriel	Services professionnels	1,70%
Industriel	Services et fournitures commerciales	1,10%
Industriel	Produits de construction	0,80%
Industriel	Infrastructures de transport	0,50%
Finances		21,40%
Communication Services		10,10%
Communication Services	Médias	5,30%
Communication Services	Services télécoms diversifiés	4,90%
Consommation discrétionnaire		8,00%
Consommation discrétionnaire	Hôtels, restaurants et loisirs	2,40%
Consommation discrétionnaire	Textiles et vêtements	2,20%
Consommation discrétionnaire	Automobiles	1,60%
Consommation discrétionnaire	Vente au détail spécialisée	1,00%
Consommation discrétionnaire	Biens durables domestiques	0,90%
Matériaux		6,10%
Matériaux	Produits chimiques	3,20%
Matériaux	Matériaux de construction	1,00%
Matériaux	Métaux et exploitation minière	1,00%
Matériaux	Production papier et forêt.	0,80%
Services publics		6,00%
Services publics	Services publics d'électricité	4,80%
Services publics	Producteurs indépendants d'électricité et d'électricité renouvelable	0,60%
Services publics	Multi-services publics	0,50%
Soins de santé		5,40%
Technologies de l'information		4,40%

Technologies de l'information	Semi-conducteurs et équipements pour semi-conducteurs.	2,70%
Technologies de l'information	Logiciels	0,90%
Technologies de l'information	Services informatiques	0,80%
Produits de consommation de base		4,30%
Énergie		3,80%
Énergie	Équipements et services énergétiques	2,70%
Énergie	Pétrole, gaz et combustibles	1,10%
Aucun		1,70%
Immobilier		1,00%
Immobilier	REITs de détail	1,00%
Exploration, exploitation minière, extraction, production, transformation, stockage, raffinage ou distribution y compris le transport, le stockage et le commerce de combustibles fossiles.		3,70%



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

Au 30 janvier 2026, la part des investissements durables ayant un objectif environnemental alignés à la Taxinomie en portefeuille est de **24,07 %**.

● Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

Oui

- Dans le gaz fossile
- Dans l'énergie nucléaire

Non

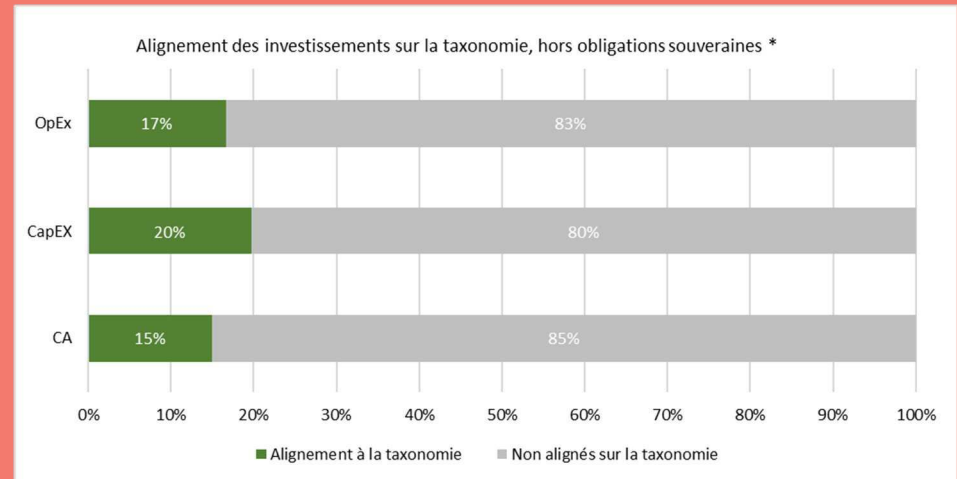
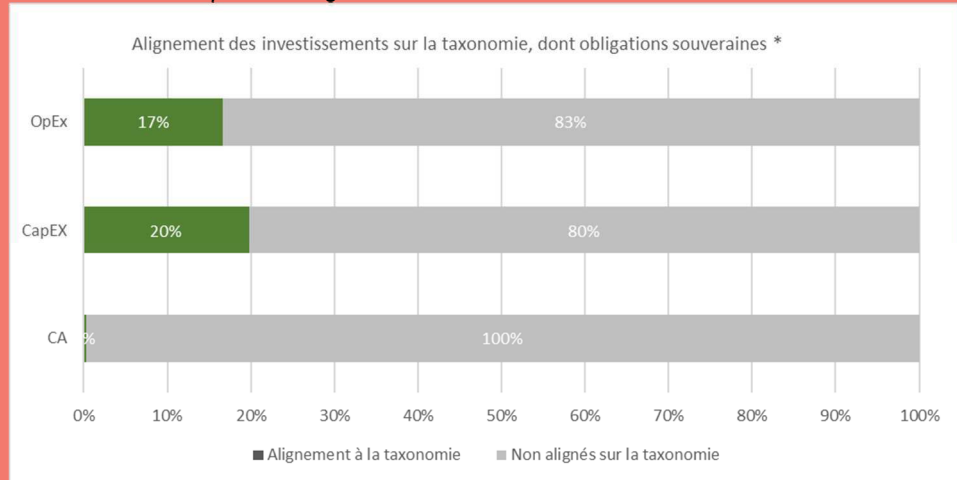
¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marche 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.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part de revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie plus verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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 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.



*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 ?**

Au 30 janvier 2026, la part des investissements dans des activités transitoires et habilitantes en portefeuille est de **10,71%**.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

N/A car aucune métrique n'était calculé sur l'exercice précédent.



Le symbole représente des investissements durable 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) 2020/852.



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

Au 30 janvier 2026, la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie était de **33,35%**.



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

Au 30 janvier 2026, la proportion d'investissements durables sur le plan social était de **14,01** %.



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

Ces investissements, qui n'ont été effectués que dans des situations spécifiques, ont consisté en :

- des liquidités ;
- des produits dérivés ;
- des valeurs ou des titres ne disposant pas d'un score ESG.

Bien que cette catégorie ne dispose pas d'une notation ESG et qu'aucune garantie minimale environnementale et sociale n'ait été mise en place, son utilisation n'a pas eu pour conséquence de dénaturer significativement ou durablement les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds.



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

Afin de respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence, toutes les données ESG ont été mises à disposition des gérants dans les outils de gestion et les différentes exigences ESG ont été paramétrées et suivies dans ces mêmes outils.



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

L'univers ISR de comparaison de ce produit financier comprend les valeurs composant l'indice Euro Stoxx Total Market Index (BKXE) après élimination de 20% des valeurs les moins bien notées qui est cohérent avec l'indicateur de référence du Fonds.

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

● 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 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.