

**Informations précontractuelles pour les produits financiers visés à l'article 8,  
paragraphe 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, 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.

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxonomie.

Dénomination du produit: EdR SICAV - TRICOLORE CONVICTIONS  
Identifiant d'entité juridique : 969500VUNBGWZ3Z6SC85

## Caractéristiques environnementales et/ ou sociales

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



Oui



Non



Il a réalisé un minimum d'investissements durables ayant un objectif environnemental de: \_\_\_\_%



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 a réalisé un minimum d'investissements durables ayant un objectif social: \_\_\_\_%



Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas eu pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de 92,14% d'investissements durables



ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxonomie de l'UE.



avec un objectif social



Il promouvait des caractéristiques E/S, mais, n'a pas réalisé pas d'investissements durables



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

Le compartiment promouvait des caractéristiques environnementales et sociales identifiées par notre modèle d'analyse ESG (Environnement, Social, Gouvernance), tels que notamment :

- Environnement : stratégie de management environnemental, consommation d'énergie, émissions de gaz à effet de serre, eau, déchet, pollution, impact vert
- Social : qualité de l'emploi, management des ressources humaines, impact social, relation parties prenantes, santé et sécurité.

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Aucun indice de référence spécifique n'avait été désigné pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le compartiment.

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

Au 30/09/2024, la note ESG du compartiment est de 12,43 versus 12,09 pour son indicateur de référence.

Concernant le label ISR, le rapport d'impact mentionne 2 KPI ESG que nous visons à surperformer par rapport à l'indicateur de référence.

Au 30/09/2024 :

	EdRS Tricolore Convictions	SBF 120
Variation d'emplois 2018-2022 (CAC 40)	+30 024	-25 946
Intensité carbone (tonnes eq CO2/Million € de CA) scopes 1 et 2	132,01	153,98

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

Au 29/09/2023, la note ESG du compartiment est de 12,26 versus 11,93 pour son indicateur de référence.

Au 29/09/2023 :

	EdRS Tricolore Convictions	SBF 120
Intensité carbone (tonnes eq CO2/Million € de CA) scopes 1 et 2	137,28	171,04

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements effectués contribuent-ils à ces objectifs?**

Etaient considérés, comme investissements durables, les sociétés contribuant positivement à un objectif environnemental ou social, les sociétés qui activaient positivement au moins un des Objectifs de Développement Durable des Nations-Unies (ODD), avec un seuil d'activation minimale de  $\geq 2,5/10$ , source MSCI, sous réserve de respect de leur conformité à l'exigence DNSH et bonne gouvernance.

Pour plus d'informations, merci de consulter le document suivant : <https://www.edmond-de-rothschild.com/SiteCollectionDocuments/Responsible-investment/OUR-ENGAGEMENT/FR/EdRAM-Definition-et-methodologie-Investissement-durable.pdf>.

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

Les investissements durables réalisés par le compartiment ont veillé à ne pas causer de préjudice important à un objectif d'investissement durable, notamment :

- via l'application de la politique d'exclusion d'Edmond de Rothschild Asset Management (France) qui intègre les armes controversées, le tabac, le charbon thermique et les énergies fossiles non conventionnelles,
- en s'assurant de ne pas investir dans des sociétés qui violeraient le UN Global Compact<sup>1</sup>

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

Des indicateurs d'incidences négatives, et notamment les indicateurs PAI présentés au sein du tableau 1 de l'annexe 1 des RTS SFDR, sont pris en compte dans le cadre du process d'investissement du compartiment, de notre modèle de notation ESG et sont également inclus dans notre définition d'investissement durable (cf. La description de la méthodologie de l'investissement durable disponible sur le site internet) . Ils sont intégrés dans les outils de suivi du portefeuille et contrôlés par l'équipe de Gestion et le département des Risques.

*La taxonomie de l'UE établit un principe consistant à «ne pas causer de préjudice important» en vertu duquel les investissements alignés sur la taxonomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxonomie 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.*

Par

ailleurs, et conformément aux requis du label ISR, les moins bonnes notations ESG (20% de l'univers d'investissement) sont exclues ainsi que les controverses les plus sévères, limitant ainsi tout impact négatif.

### ***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?***

Les gérants ont sélectionné des investissements durables 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 en excluant toute société qui violerait les principes du UN Global Compact.

<sup>1</sup> Un Global Compact: Initiative des Nations unies lancée en 2000 visant à inciter les entreprises du monde entier à adopter une attitude socialement responsable en s'engageant à intégrer et à promouvoir plusieurs principes relatifs aux droits de l'Homme, aux normes internationales du travail, à l'environnement et à la lutte contre la corruption.



## Comment ce produit financier a-t-il pris 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.

Le compartiment avait pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité en appliquant en premier lieu la politique d'exclusion d'Edmond de Rothschild Asset Management (France), notamment concernant le charbon thermique et les armes controversées. Les principales incidences négatives avaient également été prises en compte dans le cadre du modèle d'analyse ESG propriétaire ou externe des émetteurs et impactaient les scores environnementaux et sociaux ainsi que la notation ESG globale.

Les rapports périodiques du compartiment présentant, conformément à l'article 11 du règlement (UE) 2019/2088, dit règlement SFDR, notamment la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales sont respectées sont disponibles sur le site [www.edmond-de-rothschild.com](http://www.edmond-de-rothschild.com) onglet "Fund Center"



## Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier?

### Investissements les plus importants

### Secteur

### % Actifs

### Pays

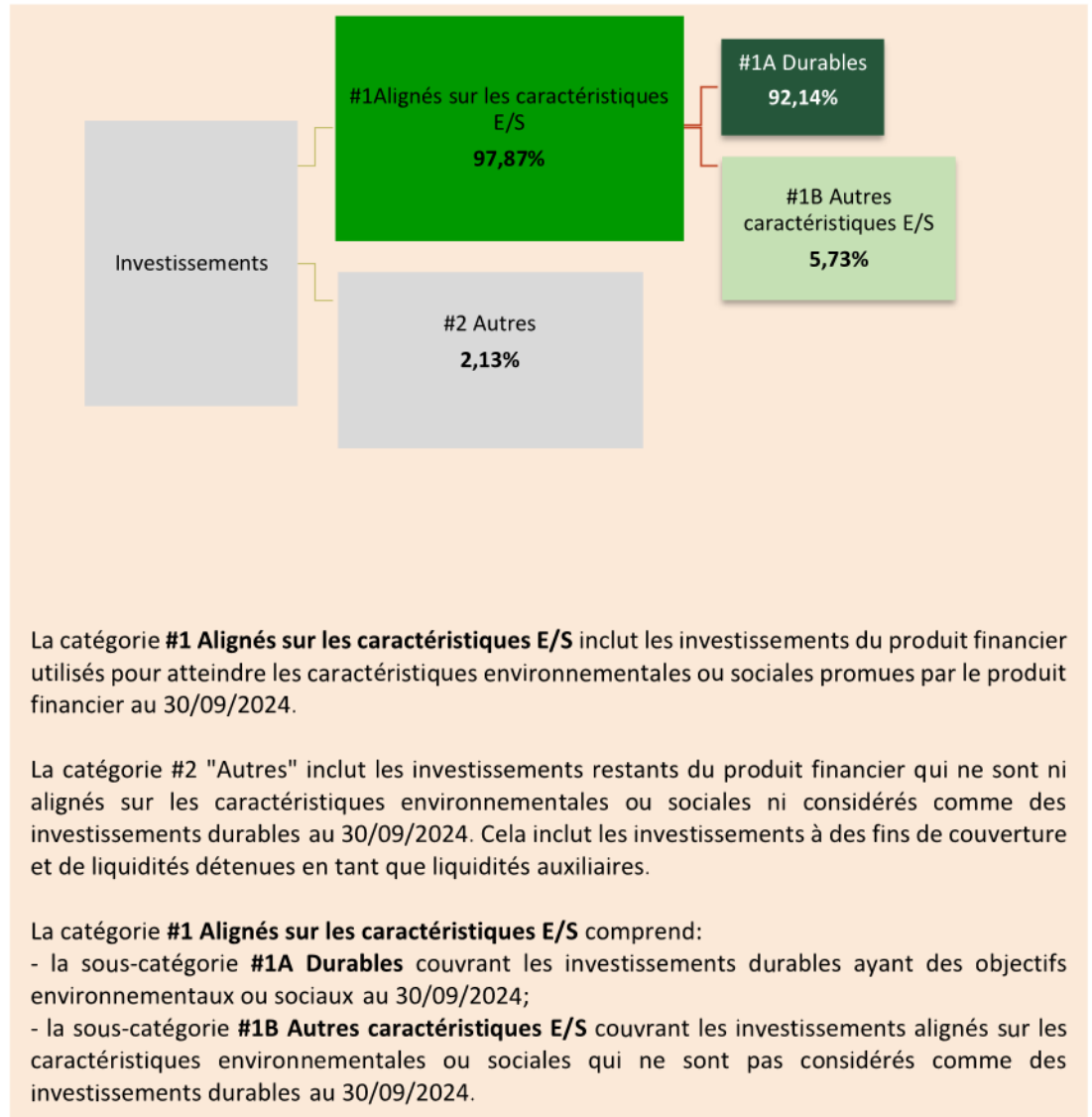
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	Conso. discrétionnaire	6,52%	France
Hermes International SCA	Conso. discrétionnaire	5,77%	France
Air Liquide SA	Matériaux	5,65%	France
BNP Paribas SA	Finance	5,52%	France
Vinci SA	Industrie	5,18%	France
Schneider Electric SE	Industrie	4,73%	France
Airbus SE	Industrie	4,55%	France
EssilorLuxottica SA	Santé	4,10%	France
L'Oreal SA	Biens cons. de base	3,88%	France
AXA SA	Finance	3,80%	France
TotalEnergies SE	Énergie	3,32%	France
Cie de Saint-Gobain SA	Industrie	3,03%	France
Danone SA	Biens cons. de base	3,02%	France
Safran SA	Industrie	3,00%	France
Sanofi SA	Santé	2,89%	France

Les données sont calculées sur la base d'un actif du fonds retraité afin de ne pas prendre en compte l'exposition des dérivés et les comptes espèces.



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

### ● Quelle était l'allocation d'actifs ?



Les activités alignées sur la taxonomie sont exprimées en pourcentage :

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

**L'allocation des actifs** décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques



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

Répartition sectorielle au 30/09/2024\*

Industrie	25,59%
Conso. discrétionnaire	13,33%
Finance	10,67%
Techno. de l'information	10,52%
Santé	10,28%
Biens cons. de base	7,50%
Énergie	6,16%
Matériaux	5,82%
Immobilier	2,42%
Services publics	1,86%
Industrie	1,76%
Télécommunications	1,64%
Techno. de l'information	1,28%
Biens cons. de base	0,69%
Liquidités	0,49%
Total	100%

\*Répartitions réalisées après décomposition des OPC sous-jacents du groupe Edmond de Rothschild.



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

Compte tenu de l'état actuel des informations non financières fournies par les entreprises, nous ne sommes pas en mesure, à ce stade, de fournir une proportion d'alignement sur la taxonomie de l'UE des investissements durables

● **Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxonomie de l'UE <sup>1</sup>?**

☐

Oui

☐

Dans le gaz fossile

☐

Dans l'énergie nucléaire

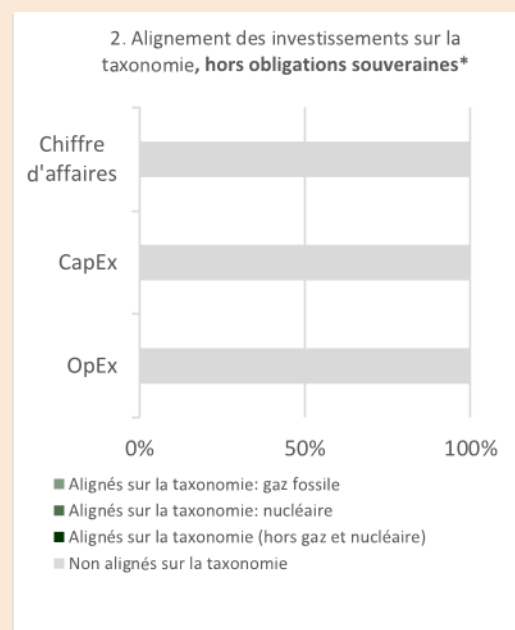
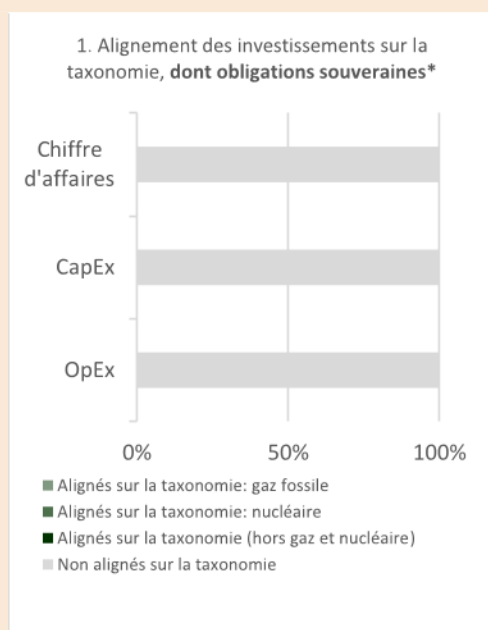
☒

Non

Compte tenu de l'état actuel des informations non financières fournies par les entreprises, nous ne sommes pas en mesure, à ce stade, d'identifier et de qualifier précisément les investissements sous-jacents inhérents aux activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformément à la Taxonomie de l'UE.

<sup>1</sup> Les activités liées au gaz fossile et/ou au 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 causent de préjudice important à aucun objectif de la taxonomie 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 taxonomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (EU) 2022/1214 de la Commission.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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 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 des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes?

Non applicable.

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

Non applicable.

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.



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

Non applicable.



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

Non applicable.



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?

La catégorie "Autres" incluait les investissements qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables. Cela incluait les investissements à des fins de couverture et de liquidités détenues en tant que liquidités auxiliaires.



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

La stratégie ESG du compartiment a pour objectif d'identifier des opportunités d'investissement, en identifiant des entreprises ayant un impact environnemental ou social positif et de bonnes performances extra-financières. Elle vise également la détection des risques extra-financiers qui pourraient se matérialiser d'un point de vue financier.

Dans ce but, le compartiment s'appuie sur une notation ESG interne ou fournie par une agence de notation externe, combinée à un filtrage négatif réalisé à partir d'une liste d'exclusion définie par la société de gestion, disponible sur son site internet.

Les critères ESG sont pris en compte à chaque étape du processus d'investissement avec la définition d'un univers éligible (élimination du dernier quintile de l'univers sur la base des notations ESG) et une analyse ESG titre par titre, avec pour certains d'entre eux une démarche active de dialogue et d'engagement.

Les gérants ont accès à des outils de suivi de portefeuille, fournissant des indicateurs climat et ESG, tels que l'Empreinte carbone ou la température du portefeuille, l'exposition aux différents objectifs de Développement Durable des Nations Unies (ODD) ainsi que la note environnementale et la note sociale des investissements. Nos outils permettent une vue consolidée du portefeuille ainsi qu'une analyse émetteur par émetteur. Notre analyse ESG propriétaire et/ou issue de fournisseurs externes attribue également un score à chacun des thèmes environnementaux et sociaux promus par le compartiment et qui sont accessibles aux gérants.



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

Aucun indice de référence spécifique n'a été désigné pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le compartiment.

#### **● 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 financier 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?**

Au 30/09/2024, la note ESG du compartiment est de 12,43 versus 12,09 pour son indicateur 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.