

**Modèle d'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 dans lesquelles le produit financier investi 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:  
Fidelity Funds - Sustainable US Equity Fund

Identifiant d'entité juridique:  
549300J1XTC50ZY0Z742

**Objectif d'investissement durable**

| <b>Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable?</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <input checked="" type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> Oui                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | <input type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> Non                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| <input checked="" type="checkbox"/> Il a réalisé des <b>investissements durables ayant un objectif environnemental</b> : 37,46%<br><br><input checked="" type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxonomie de l'UE<br><br><input checked="" type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxonomie de l'UE | <input type="checkbox"/> Il promouvait des <b>caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)</b> et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de __% d'investissements durables<br><br><input type="checkbox"/> 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<br><br><input type="checkbox"/> 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<br><br><input type="checkbox"/> ayant un objectif social |
| <input checked="" type="checkbox"/> Il a réalisé des <b>investissements durables ayant un objectif social</b> : 60,22%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | <input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais <b>n'a pas réalisé d'investissements durables</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |



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

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

À compter du 31 juillet 2024, l'approche du Compartiment à l'égard des objectifs d'investissement durable a été révisée conformément au Cadre d'investissement durable actualisé de Fidelity, comme cela est décrit dans le document d'informations précontractuel du Compartiment. Bien que le Compartiment fonctionne désormais conformément au cadre actualisé, la manière dont le Compartiment atteint l'objectif d'investissement durable n'a pas changé.

Le Compartiment a respecté l'objectif d'investissement durable comme cela est défini dans le document d'informations SFDR précontractuel pour la période. Le Compartiment a cherché à atteindre une croissance du capital sur le long terme en investissant dans des investissements durables.

Le Compartiment a déterminé que les investissements durables étaient des investissements dans :

(a) des titres d'émetteurs dont les activités économiques contribuent de manière substantielle (plus de 50% pour les sociétés émettrices) à :

(i) un ou plusieurs objectifs environnementaux énoncés dans la Taxonomie de l'UE et qui sont considérées comme des activités durables sur le plan environnemental conformément à la Taxonomie de l'UE ; ou

(ii) des objectifs environnementaux ou sociaux qui sont conformes à un ou plusieurs Objectifs de développement durable des Nations Unies (« ODD ») ; ou

(b) des émetteurs contribuant à la réalisation d'un objectif de décarbonisation destiné à maintenir la hausse de la température mondiale en dessous de 1,5 degré ; ou

(c) des obligations dont la majorité du produit devrait être utilisée pour des activités, des actifs ou des projets spécifiques contribuant à des objectifs environnementaux ou sociaux ; sous réserve qu'ils ne causent pas de préjudice important à un objectif environnemental ou social et que les sociétés détenues respectent des pratiques de bonne gouvernance.

Le Gérant de Portefeuille a sélectionné les émetteurs en fonction de la contribution de leurs activités économiques aux objectifs environnementaux ou sociaux conformes aux ODD.

Les ODD sont une série d'objectifs publiée par les Nations Unies qui reconnaît que l'élimination de la pauvreté et de toute autre forme de privation doit être associée à une amélioration dans les domaines de la santé, de l'éducation, de la croissance économique et de la réduction des inégalités, tout en luttant contre les changements climatiques et en œuvrant à la préservation des océans et des forêts de la planète. Pour de plus amples détails, veuillez vous référer au site de l'ONU :

<https://sdgs.un.org/goals>. Les ODD axés sur le domaine environnemental comprennent : eau propre

et assainissement ; énergie propre et d'un coût abordable ; consommation et production responsables ; et lutte contre les changements climatiques. Les ODD axés sur le domaine social comprennent : pas de pauvreté ; faim « zéro » ; travail décent et croissance économique ; industrie, innovation et infrastructure ; villes et communautés durables et sûres.

Le Compartiment a systématiquement appliqué les exclusions telles que définies dans le document d'informations SFDR précontractuel.

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

Pour la période du 1er mai 2024 au 30 avril 2025, les indicateurs de durabilité suivants ont été utilisés pour mesurer la réalisation de l'objectif d'investissement durable du

Compartiment :

i) le pourcentage du Compartiment investi dans des investissements durables : 97,68%

ii) le pourcentage du Compartiment investi dans des investissements durables ayant un objectif environnemental et associés à des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu de la Taxonomie de l'UE : 36,03%

iii) le pourcentage du Compartiment investi dans des investissements durables ayant un objectif social : 60,22%

iv) le pourcentage du Compartiment investi dans des titres d'émetteurs exposés aux Exclusions (définies ci-dessous) : 0%

Ces indicateurs de durabilité n'ont pas été contrôlés par un réviseur d'entreprises ni analysés par un tiers.

**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.

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

Pour la période du 1er mai 2022 au 30 avril 2023, sans objet, car ce Compartiment a été élevé au rang des Compartiments visés par l'Article 9 le 3 août 2023 2023.

Pour la période du 3 août 2023 et 30 avril 2024, les indicateurs de durabilité suivants ont été utilisés pour mesurer la réalisation de l'objectif d'investissement durable du Compartiment :

- i) le pourcentage du Compartiment investi dans des investissements durables : 97,3%
- ii) le pourcentage du Compartiment investi dans des investissements durables ayant un objectif environnemental et associés à des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu de la Taxonomie de l'UE : 30,58%
- iii) le pourcentage du Compartiment investi dans des investissements durables ayant un objectif social : 65,91%
- iv) le pourcentage du Compartiment investi dans des titres d'émetteurs exposés aux Exclusions (définies ci-dessous) : 0%

Ces indicateurs de durabilité n'ont pas été contrôlés par un réviseur d'entreprises ni analysés par un tiers.

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

Les investissements durables ont été examinés pour déterminer s'ils participent à des activités qui causent des préjudices importants et génèrent des controverses, ce qui est établi en vérifiant que l'émetteur a respecté les garanties minimales et les normes relatives aux principales incidences négatives (PIN) ainsi que les mesures de performance par rapport aux PIN.

Il s'agissait notamment : des analyses normatives : l'analyse des titres identifiés dans les analyses normatives existantes de Fidelity (telles qu'établies ci-dessous) ; des analyses des activités : l'analyse des émetteurs en fonction de leur participation à des activités ayant des incidences négatives importantes sur la société ou l'environnement, y compris les émetteurs considérés comme faisant l'objet d'une controverse « très grave » à l'aide des analyses des controverses, couvrant 1) les questions environnementales, 2) les droits de l'homme et les droits des communautés, 3) le droit du travail et la chaîne d'approvisionnement, 4) les clients, 5) la gouvernance ; et des indicateurs des PIN : les données quantitatives (si disponibles) sur les indicateurs des PIN sont utilisées pour évaluer si un émetteur a été impliqué dans des activités qui causent un préjudice important à un objectif environnemental ou social.

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

Dans le cas des investissements durables, tels que définis ci-dessus, Fidelity a réalisé une évaluation quantitative afin d'identifier les émetteurs dont la performance par rapport aux indicateurs des PIN a été difficile. Tous les indicateurs obligatoires et pertinents pour les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité énoncés à l'Annexe 1 des normes techniques de réglementation du Règlement SFDR de l'UE ont été pris en compte (lorsque les données étaient disponibles).

Les émetteurs ayant un score global faible ne seront pas acceptés en tant qu'« investissements durables » à moins que la recherche fondamentale de Fidelity n'établisse que l'émetteur n'a pas violé les exigences consistant à « ne pas causer de préjudice important » ou qu'il a commencé à atténuer les incidences négatives grâce à une gestion efficace ou à une transition.

***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:***

Des analyses normatives seront appliquées : pour les émetteurs identifiés comme étant incapables de se comporter de manière à assumer leurs responsabilités fondamentales en matière de droits de l'homme, de droits du travail, d'environnement et de lutte contre la corruption, conformément aux normes internationales, y compris celles énoncées dans les Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales, les Principes directeurs des Nations Unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, le Pacte mondial des Nations Unies (PMNU), les Normes de l'OIT et les Conventions de l'Organisation internationale du Travail (OIT), ne seront pas considérés comme des investissements durables.



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

Les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité (appelées « principales incidences négatives ») ont été prises en compte et intégrées dans les décisions d'investissement au moyen de divers outils, notamment :

(i) la Notation ESG : Fidelity se réfère aux notations ESG qui intègrent la prise en compte des principales incidences négatives importantes telles que les émissions carbone, la sécurité des employés, la corruption et la gestion de l'eau. Pour les titres souverains émis, les principales incidences négatives ont été prises en compte et intégrées dans les décisions d'investissement à l'aide de notations qui incluent les principales incidences négatives importantes comme les émissions carbone, les violations sociales et la liberté d'expression.

(ii) les Exclusions : lorsqu'il a investi directement dans des sociétés émettrices, le Compartiment a appliqué les Exclusions pour permettre d'atténuer les principales incidences négatives en excluant les secteurs préjudiciables et en interdisant les investissements dans des émetteurs qui enfreignent les normes internationales, telles que le PMNU. Ces Exclusions ont contribué à atténuer l'indicateur PIN 4 : Exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, l'indicateur PIN 10 : Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et l'indicateur PIN 14 : Exposition à des armes controversées.

(iii) l'Engagement : Fidelity a utilisé l'engagement comme outil pour mieux comprendre les principales incidences négatives et, dans certaines circonstances, préconiser une réduction des principales incidences négatives. Fidelity a participé à des engagements individuels et collaboratifs pertinents qui ciblent un certain nombre de principales incidences négatives (c.-à-d. Climate Action 100+, Investors against Slavery and Trafficking APAC).

(iv) le Vote : la politique de vote de Fidelity comprend des normes minimales explicites concernant la diversité des genres au sein des conseils d'administration et un engagement des sociétés émettrices face aux changements climatiques. Fidelity peut également utiliser son vote pour aider à réduire les principales incidences négatives.

(v) un réexamen trimestriel : une discussion sur les principales incidences négatives et une analyse de ces dernières par le biais d'un examen trimestriel du Compartiment.

Fidelity a tenu compte d'indicateurs spécifiques pour chaque facteur de durabilité pour déterminer si les investissements ont une principale incidence négative. Ces indicateurs étaient assujettis à la disponibilité des données et peuvent évoluer avec l'amélioration de la qualité et de la disponibilité des données.

Les exclusions et analyses ci-dessus (les « Exclusions ») peuvent être mises à jour de temps à autre. Pour de plus amples informations, veuillez consulter la page de ce site intitulée : [« Sustainable investing framework » \(Cadre d'investissement durable\)](#).



## 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:  
01/05/2024 - 30/04/2025

| Investissements les plus importants | Secteur                       | % d'actifs | Pays       |
|-------------------------------------|-------------------------------|------------|------------|
| Microsoft                           | Technologies de l'information | 6,49%      | États-Unis |
| Alphabet (A)                        | Technologies de l'information | 4,81%      | États-Unis |
| NextEra Energy                      | Services publics              | 4,44%      | États-Unis |
| Boston Scientific                   | Santé                         | 4,25%      | États-Unis |
| NVIDIA                              | Technologies de l'information | 4,04%      | États-Unis |
| Salesforce                          | Technologies de l'information | 3,78%      | États-Unis |
| RenaissanceRe Holdings              | Finance                       | 3,68%      | Bermudes   |
| Elevance Health                     | Santé                         | 3,26%      | États-Unis |
| Visa                                | Finance                       | 3,22%      | États-Unis |
| UnitedHealth Group                  | Santé                         | 2,93%      | États-Unis |
| Danaher                             | Santé                         | 2,92%      | États-Unis |
| Broadcom                            | Technologies de l'information | 2,5%       | États-Unis |
| Advanced Drainage Systems           | Industries                    | 2,45%      | États-Unis |
| Stryker                             | Santé                         | 2,43%      | États-Unis |
| Smurfit WestRock                    | Matériaux                     | 2,42%      | Irlande    |

Source des données : Fidelity International, au 30 avril 2025.

Les investissements les plus importants (à l'exclusion des instruments dérivés) et leurs classifications s'appuient sur des données comptables officielles et sont basés sur le dernier jour de la période de référence. Toute différence avec les pourcentages présentés dans les portefeuilles des états financiers résulte des arrondissements.



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

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

Le Compartiment a investi 97,68 % de ses actifs dans des investissements durables.

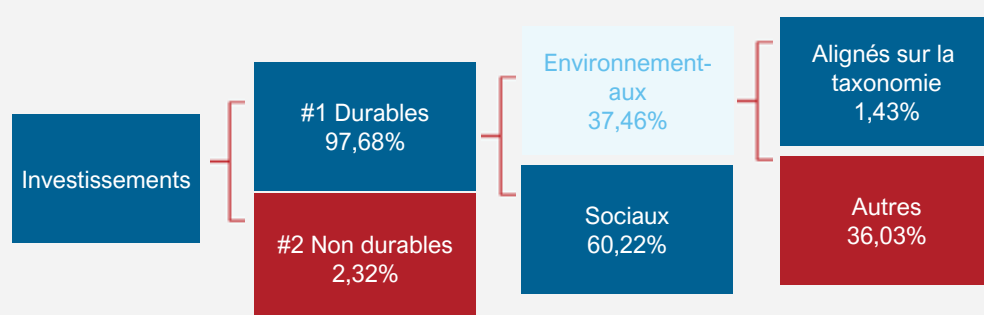
### Quelle était l'allocation des actifs?

La part des investissements du Compartiment utilisée pour respecter l'objectif d'investissement durable, conformément aux éléments contraignants de la stratégie d'investissement du produit financier, s'élève à 97,68 %, ce qui correspond à la part du Compartiment placée dans des investissements durables. Cela comprenait 1,43 % d'actifs ayant un objectif environnemental (qui est aligné sur la Taxonomie de l'UE), 36,03 % d'actifs ayant un objectif environnemental (qui n'est pas aligné sur la Taxonomie de l'UE) et 60,22 % d'actifs ayant un objectif social.

Les données concernant la Taxonomie de l'UE proviennent d'un fournisseur de données tiers. L'évaluation de l'alignement sur la Taxonomie de l'UE est réalisée à l'aide des données déclarées par les sociétés dans lesquelles nous investissons. La méthodologie appliquée par le fournisseur de données tiers évalue la manière dont les sociétés sont impliquées dans des activités économiques qui contribuent de manière substantielle à un objectif environnemental sans nuire de manière significative à d'autres objectifs durables et en respectant des garanties sociales minimales.

Le reste des investissements est essentiellement utilisé de la manière décrite dans la question : « Quels sont les investissements inclus dans "#2 Autres", quel est leur objectif et existe-t-il des garanties environnementales ou sociales minimales ? »

Cette allocation d'actifs, y compris la conformité à la Taxonomie de l'UE, n'a pas été contrôlée par un réviseur d'entreprises ni analysée par un tiers.



La catégorie **#1 Durables** couvre les investissements durables ayant des objectifs environnementaux ou sociaux.

La catégorie **#2 Non durables** inclut les investissements qui ne sont pas durables.

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

| Secteur                               | Sous Secteur                                            | % d'actifs |
|---------------------------------------|---------------------------------------------------------|------------|
| Consommation Courante                 | Produits Alimentaires                                   | 1,14%      |
| Consommation Non Essentielle          | Biens Ménagers Durables                                 | 2,06%      |
|                                       | Services Aux Consommateurs Diversifiés                  | 1,62%      |
|                                       | Composants Automobiles                                  | 1,53%      |
|                                       | Hôtels, Restaurants & Loisirs                           | 1,47%      |
| Finance                               | Services Financiers Diversifiés                         | 3,94%      |
|                                       | Assurance                                               | 3,68%      |
| Fonds De Placement À Capital Variable | Fonds Monétaire À Capital Fixe                          | 2,23%      |
| Immobilier                            | Actions – Actions Ordinaires – Immobilier – Résidentiel | 1,05%      |
| Industries                            | Produits De Construction                                | 2,45%      |
|                                       | Transport Routier & Ferroviaire                         | 2,4%       |
|                                       | Construction & Ingénierie                               | 2,21%      |
|                                       | Services & Approvisionnements Commerciaux               | 1,87%      |
|                                       | Matériel Électrique                                     | 1,83%      |
|                                       | Machines-Outils                                         | 1,25%      |
| Matériaux                             | Conteneurs & Emballages                                 | 2,42%      |
|                                       | Produits Chimiques                                      | 0,6%       |
| Santé                                 | Fournisseurs & Services De Soins De Santé               | 8,54%      |
|                                       | Outils & Services Pour Les Sciences De La Vie           | 6,66%      |
|                                       | Équipement & Fournitures De Soins De Santé              | 10,71%     |
| Services Publics                      | Services D'électricité                                  | 4,44%      |
| Technologies De L'information         | Logiciels & Services Internet                           | 4,81%      |
|                                       | Logiciel                                                | 15,29%     |
|                                       | Équipements & Produits Semi-Conducteurs                 | 14,56%     |
|                                       | Instruments & Composants D'équipements Électroniques    | 1,25%      |

Source des données : Fidelity International, au 30 avril 2025.

La répartition sectorielle des investissements (à l'exclusion des instruments dérivés) et leur classification sont basées sur les données comptables officielles et sur le dernier jour de la période de référence. Toute différence avec les pourcentages présentés dans les portefeuilles des états financiers résulte des arrondissements.

En raison du manque de données, nous ne sommes pas en mesure de communiquer les informations concernant le pourcentage des investissements effectués dans les secteurs et sous-secteurs économiques tirant leurs revenus de l'exploration, l'exploitation minière, l'extraction, la production, le traitement, le stockage, le raffinage ou la distribution, y compris le transport, le stockage et le commerce, de combustibles fossiles. À l'heure actuelle, ces investissements sont couverts par un autre groupe de combustibles fossiles.

Pour être conforme à la taxonomie 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



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

La part moyenne trimestrielle des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la Taxonomie de l'UE s'élevait à 1,43 %. Cela a contribué aux objectifs environnementaux suivants :

- 1) atténuation des changements climatiques : 0,63%
- 2) adaptation aux changements climatiques : 0%
- 3) protection de l'eau et des ressources marines : 0%
- 4) transition vers une économie circulaire : 0%

carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de 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.

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; - **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, 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 a investi.

- 5) prévention et contrôle de la pollution : 0%  
6) protection et restauration de la biodiversité et des écosystèmes : 0%

La conformité des investissements du Compartiment à la Taxonomie de l'UE n'a pas été contrôlée par les réviseurs d'entreprises ni analysée par des tiers. L'alignement des investissements sous-jacents du Compartiment sur la Taxonomie est mesuré par le chiffre d'affaires.

C'est la première année que nous incluons les contributions aux objectifs environnementaux élargis de la Taxonomie de l'UE, qui couvrent désormais la protection de l'eau et des ressources marines, la transition vers une économie circulaire, la prévention et le contrôle de la pollution, et la protection et la restauration de la biodiversité et des écosystèmes.

Pour tenir compte de ces ajouts, l'approche de la déclaration de cette année a été modifiée :

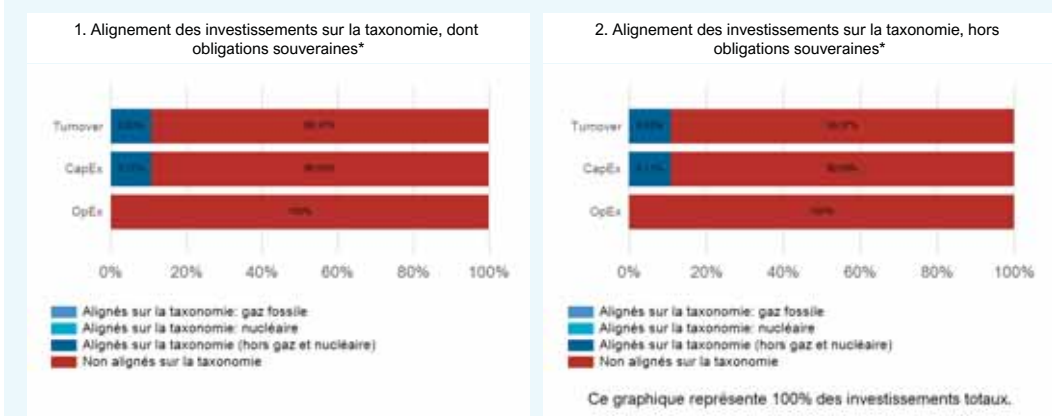
Pour « l'atténuation des changements climatiques » et « l'adaptation aux changements climatiques », l'approche n'a pas été modifiée et les données ont été compilées sur la base de la moyenne trimestrielle des données relevées à la fin du calendrier au 31 juillet 2024, au 31 octobre 2024, au 31 janvier 2025 et au 30 avril 2025.

Pour les nouveaux objectifs (« protection de l'eau et des ressources marines », « transition vers une économie circulaire », « prévention et contrôle de la pollution » et « protection et restauration de la biodiversité et des écosystèmes »), nous avons utilisé la moyenne trimestrielle des données relevées 31 janvier 2025 et au 30 avril 2025 en raison de la période limitée pendant laquelle ces données ont été disponibles.

### 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

Les graphiques ci-dessous font apparaître en bleu 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.

Source des données : Moody's, moyenne trimestrielle sur la période de référence.

Les données ci-dessus ont été compilées à partir des données statiques de notre système de négociation et de conformité et enrichies par Moody's, une source de données externe. Les données ont été compilées sur la base des données du dernier jour de clôture du trimestre civil et ont fait l'objet d'une moyenne pour la période de référence. Il peut y avoir des divergences dans les chiffres de la Taxonomie de l'UE communiqués en raison de différences dans la méthode de calcul appliquée.

<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 (UE) 2022/1214 de la Commission.

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

La part des investissements placée dans des activités transitoires et habilitantes au sens du règlement sur la Taxonomie de l'UE et mesurée par le chiffre d'affaires, est de 0 % pour les activités transitoires et de 0,49 % pour les activités habilitantes.

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

Pour la période du 1er mai 2022 au 30 avril 2023, sans objet, car ce Compartiment a été élevé au rang des Compartiments visés par l'Article 9 le 3 août 2023.

Pour la période du 3 août 2023 et 30 avril 2024, la part moyenne trimestrielle des investissements durables (y compris les obligations souveraines) ayant un objectif environnemental aligné sur la Taxonomie de l'UE s'élevait à 1,43% sur la base du chiffre d'affaires, 1,08% sur la base des dépenses d'immobilisation et 0,0% sur la base des dépenses d'exploitation.

La part moyenne trimestrielle des investissements durables (hors obligations souveraines) ayant un objectif environnemental aligné sur la Taxonomie de l'UE s'élevait à 1,43% sur la base du chiffre d'affaires, 1,08% sur la base des dépenses d'immobilisation et 0,0% sur la base des dépenses d'exploitation.



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 qui n'étaient pas alignés sur la taxonomie de l'UE?

La part moyenne trimestrielle des investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'est pas aligné sur la Taxonomie de l'UE s'élevait à 36,03 %.

Les activités économiques qui ne sont pas reconnues par la Taxonomie de l'UE ne sont pas nécessairement nuisibles à l'environnement ou non durables. En outre, la Taxonomie de l'UE n'a pas encore intégré toutes les activités susceptibles d'apporter une contribution substantielle aux objectifs environnementaux et sociaux.



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

La part moyenne trimestrielle des investissements durables ayant un objectif social s'élevait à 60,22 %.

Cela a contribué aux objectifs des ODD axés sur le domaine social, comme expliqué dans la réponse concernant les objectifs des investissements durables ci-dessus.



### 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?

Les investissements restants du Compartiment ont été effectués dans des actifs alignés sur l'objectif financier du Compartiment, dans des liquidités et autres instruments assimilés à des fins de liquidité et dans des instruments dérivés utilisés à des fins d'investissement et de gestion efficace du portefeuille. À titre de garantie environnementale et sociale minimale, le Compartiment a respecté les Exclusions.



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

Le Compartiment a pris les mesures suivantes pour atteindre l'objectif d'investissement durable :

1. Le Compartiment a réalisé des investissements durables.
2. Les caractéristiques ESG qualitatives et quantitatives du Compartiment ont été discutées et analysées lors du réexamen trimestriel de la durabilité.
3. Le Compartiment a appliqué les Exclusions.



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

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

Aucun indice de référence n'a été désigné pour déterminer si le Compartiment atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

### ***En quoi l'indice de référence différerait-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 l'objectif d'investissement durable?***

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?***

Non applicable