

Dénomination du produit : LYSIS ESG THEMATIC S

Identifiant d'entité juridique : 969500ICIOHT6SQEIR98

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il réalisera un minimum d'investissements durables avec un objectif environnemental :_%

dans des activités économiques qui sont considérées durable 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 réalisera un minimum d'investissements durables avec un objectif social :_%

Il promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il contiendra une proportion minimale de % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental 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 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 promeut les caractéristiques E/S, mais ne réalise pas d'investissements durables

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 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 dresse 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.



Les indicateurs de durabilité évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Quelles caractéristiques environnementales et/ou sociales sont promues par ce produit financier ?

L'OPCVM LYSIS ESG THEMATIC S promeut des caractéristiques environnementales et sociales et est qualifié comme un produit financier article 8 conformément au règlement SFDR. Ce produit financier vise à concilier la performance financière avec des critères extra-financiers : environnementaux, sociétaux et de gouvernance (ESG).

La prise en compte de ces critères doit apporter à l'entreprise une meilleure compréhension des enjeux de demain. Labellisé ISR, ce produit promeut toutes les caractéristiques environnementales et sociales qui y sont liées. La stratégie d'investissement responsable est la réduction de l'impact environnemental des entreprises en matière de pollution de l'air,

la protection de la biodiversité, la prise en compte par les entreprises des risques environnementaux... ou encore l'amélioration des conditions de travail, la protection des employés, la lutte contre les discriminations ...

En particulier, l'objectif d'investissement affiché pour les fonds LYSIS ESG THEMATIC S est l'appréciation du capital au moyen de l'investissement dans des organismes de placement collectif, sélectionnés par le biais d'un processus d'investissement qui inclut systématiquement des considérations d'ordre environnemental, social et de gouvernance (« ESG »).

S'agissant d'un fonds de fonds labellisé ISR, les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont promues par la sélection d'Organismes de Placement Collectif (OPC) labellisés ISR (Investissement Socialement Responsable). 90% de l'encours du fonds doit être au minimum labellisé ISR. L'objectif sera réalisé en investissant sur des fonds thématiques présentant des perspectives de croissance élevées à long terme selon l'analyse du gérant. Ces thématiques découlant de tendances affectant durablement la société et l'économie par la prise en compte d'aspects environnementaux, sociaux et de gouvernance, le processus de sélection conduira à réaliser une analyse macro-économique permettant de déterminer les thèmes les plus adaptés à la situation politique, économique et financière.

Le fonds présente une approche multi-thématiques autour des thématiques telles que la santé et le mode de vie, l'environnement et l'impact, l'énergie renouvelable et l'eau, la technologie et l'intelligence artificielle, données à titre d'exemples (liste non exhaustive et non limitative). Aucune des thématiques d'investissement n'est structurellement privilégiée mais certains choix ponctuels sont réalisés selon les anticipations de la société de gestion de portefeuille. Ainsi, le fonds pourra investir dans des fonds présentant un mixte de thématiques respectant les critères ESG. A cette première analyse s'ajoutera une approche intra-thématique visant à sélectionner les fonds au processus de gestion le plus cohérent et pérenne, selon l'analyse du gérant. Le processus de sélection des sous-jacents intègrera une évaluation des critères ESG.

- ***Quels sont les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?***

Le Fonds se qualifie comme un produit financier répondant à l'article 8 du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (ci-après « SFDR »). Au sens de la Position-Recommandation AMF 2020-03, l'approche extra-financière mise en œuvre dans le fonds est fondée sur un engagement significatif dans la stratégie d'investissement permettant ainsi une communication centrale sur la prise en compte de critères extra-financiers. La réalisation des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier se mesure par la sélection d'Organismes de Placement Collectif (OPC) labellisés ISR (Investissement Socialement Responsable) et le suivi par transparence d'indicateurs tel que (liste non exhaustive) : la mise en place d'un process ESG ; l'adhésion aux PRI ; l'existence d'une politique de vote ; l'existence d'une politique d'exclusions sectorielles...

Par ailleurs, les fonds labellisés ISR doivent suivre un ou plusieurs indicateurs d'impact engageants (environnemental, social, gouvernance ou sur les droits humains). Ce produit financier a décidé de suivre les indicateurs suivants :

- Evolution du taux de de sociétés signataires du pacte mondial de l'ONU : cet indicateur représente le pourcentage moyen des entreprises qui sont en ligne avec les 10 principes du Pacte Mondial des Nations Unies relatifs au respect des droits humains, aux normes internationales du travail, à l'environnement et à la lutte contre la corruption ;

- Evolution de l'empreinte carbone, sur la base des émissions de GES (scope 1 et 2) sur les ventes : cet indicateur mesure l'Intensité carbone (en tonnes d'émissions de CO2 équivalent / million USD de chiffre d'affaire). Ce chiffre représente le total des émissions carbone engendrées par les entreprises détenues dans le portefeuille (exprimées en tonnes d'équivalent CO2), par million de USD de chiffre d'affaires. Pour calculer les émissions carbonées de l'entreprise nous utilisons les émissions du Scope 1 (émissions directes induites par la combustion d'énergie fossile) et du Scope 2 (émissions indirectes induites par l'achat ou la production d'électricité). Ainsi, pour chaque million de USD de chiffre d'affaire, les entreprises du portefeuille émettent X tonnes d'équivalent CO2 ;
- Evolution du taux de représentativité des femmes au conseil d'administration : cet indicateur représente le pourcentage moyen de femmes siégeant au conseil d'administration parmi les sociétés du portefeuille.
- Evolution du taux d'indépendance des directeurs au conseil d'administration : La qualité de la gouvernance est depuis toujours un critère déterminant de notre politique d'investissement. Une gouvernance satisfaisante est une garantie de transparence et d'équilibre des pouvoirs, ainsi qu'un contre-pouvoir actionnarial. Cet indicateur représente le pourcentage moyen d'indépendance du conseil d'administration parmi les sociétés du portefeuille.

Sur la base de ces indicateurs, le produit financier doit obtenir un meilleur résultat sur au moins deux indicateurs d'impact engageants présentés ci dessus par rapport à leur indice de référence ou univers de départ. Pour le premier indicateur, le taux de couverture du portefeuille devra être d'au moins 90 % : nous avons choisi de présenter le pourcentage moyen d'indépendance du conseil d'administration. L'indépendance des administrateurs siégeant au conseil d'administration est essentielle pour assurer une bonne gouvernance de l'entreprise et préserver ainsi les intérêts de toutes les parties prenantes. Pour le second, le taux de couverture du portefeuille devra être d'au moins 70 % : nous avons choisi de présenter l'intensité carbone.

- ***Quels sont les objectifs des investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre et comment les investissements effectués contribuent-ils à ces objectifs ?***

L'OPCVM LYSIS ESG THEMATICS n'a pas pour objectif de réaliser des investissements durables.

- ***Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre ne causent-ils pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?***

L'OPCVM LYSIS ESG THEMATICS n'a pas pour objectif de réaliser des investissements durables.

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

L'OPCVM LYSIS ESG THEMATICS ne prend pas en compte les principales incidences négatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité, conformément à l'article 4 paragraphe 1(b) du règlement SFDR, l'équipe de gestion favorisant un plus large degré de diversification des risques émetteurs.

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 sont-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ?

L'OPCVM LYSIS ESG THEMATICIS n'a pas pour objectif de réaliser des investissements durables.

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 de cet OPCVM ne prennent pas en compte les critères de l'Union Européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. L'alignement avec le Règlement Taxonomie n'est donc pas calculé. Par conséquent, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements en portefeuille.

Ce produit financier prend-il en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

OUI

NON



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

Quelle est la stratégie d'investissement suivie par ce produit financier ?

L'OPCVM LYSIS ESG THEMATICIS, a pour objectif la recherche d'une performance, nette de frais de gestion, supérieure à son indicateur de référence MSCI World NR Eur index dividendes réinvestis, sur un horizon de placement minimum recommandé supérieur à 5 ans en investissant à hauteur de 90% minimum en OPC ayant le label ISR ou un label européen équivalent, découlant de tendances affectant durablement la société et l'économie par la prise en compte d'aspects environnementaux, sociaux et de gouvernance « ESG ».

Le gérant de Lysis ESG Thematics investit ainsi sur des actions internationales via des fonds thématiques présentant des perspectives des croissances élevées à long terme. Ces thématiques découlent de tendances affectant durablement la société et l'économie.

Aussi, la prise en compte d'aspects environnementaux, sociaux et de gouvernance dans le processus de sélection conduit le gérant à réaliser une analyse macro-économique permettant de déterminer les thèmes les plus adaptés à la situation politique, économique et financière.

Le fonds est un fonds dit « multithématiques ». Il s'intéresse donc de près à des secteurs tels que la santé et le mode de vie, l'environnement et l'impact, l'énergie renouvelable et l'eau, la technologie et l'intelligence artificielle.

Aucune des thématiques d'investissements n'est structurellement privilégiée mais certains choix ponctuels sont réalisés selon les anticipations du gérant.

Le gérant complète sa sélection des fonds par une analyse stricte et poussée du processus d'investissements qui est mis en œuvre par chaque fonds et sa maison mère.

Enfin, Le processus de sélection des sous-jacents intègrera une évaluation des critères ESG.

La stratégie d'investissement du fonds étant exclusivement déclinée à travers d'une sélection d'OPCVM gérés activement et passivement, le gérant doit s'assurer systématiquement qu'au moins 90% d'entre eux bénéficient du label public d'Etat ISR.

L'approche ESG a pour objectif d'intégrer des critères extra-financiers notamment environnementaux, sociétaux et de gouvernance dans la sélection des fonds composant le portefeuille. Ainsi les fonds sélectionnés auront obtenu le label public français ISR ou un label européen équivalent.

- ***Quelles sont les contraintes définies dans la stratégie d'investissement pour sélectionner les investissements afin d'atteindre chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par ce produit financier ?***

Comme détaillé ci-dessus, en réponse aux précédentes questions, les éléments contraignants de la stratégie d'investissement utilisés pour sélectionner les investissements afin d'atteindre chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par l'OPCVM sont :

- L'investissement à hauteur de 90% minimum dans des OPC qui possèdent le label public d'Etat ISR ou un label européen équivalent ;
- La politique d'exclusions sectorielles.

Ces éléments sont contraignants car ils viennent réduire l'univers d'investissement. Aux filtres d'exclusion et de label ISR s'ajoutent les filtres « Thématique » et « Conviction » ESG.

- ***Dans quelle proportion minimale le produit financier s'engage-t-il à réduire son périmètre d'investissement avant l'application de cette stratégie d'investissement ?***

Non applicable dans le cadre d'un fonds de fonds.

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

- **Quelle est la politique mise en œuvre pour évaluer les pratiques de bonne gouvernance des sociétés dans lesquelles le produit financier investi ?**

La qualité de la gouvernance est depuis toujours un critère déterminant de notre politique d'investissement. Une gouvernance satisfaisante est une garantie de transparence et d'équilibre des pouvoirs, ainsi qu'un contre-pouvoir actionnarial.

Les pratiques de bonne gouvernance sont évaluées dans le cadre de la notation ESG par le suivi des politiques de vote mises en œuvre au sein des sociétés de gestion sélectionnées.

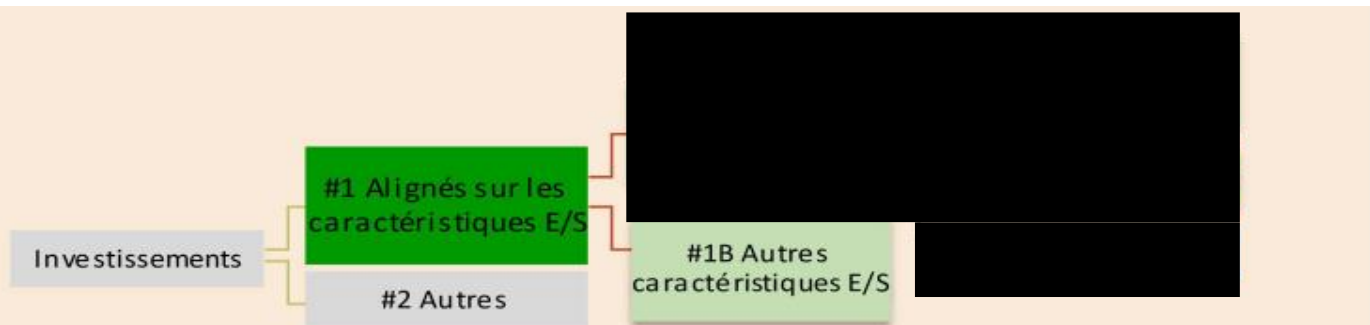
Par ailleurs, ce produit financier, labellisé ISR suit deux indicateurs de performance sur le volet gouvernance : le taux de représentativité des femmes au conseil d'administration et le taux d'indépendance des directeurs au conseil d'administration.



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

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

Le produit financier investit au moins 90% de son actif net dans des actifs qui ont fait l'objet d'une évaluation ESG selon le processus en place – donc dans des investissements qui sont alignés avec les caractéristiques environnementales et sociales promues (#1 Alignés avec les caractéristiques E/S). Jusqu'à 10% de l'actif net n'est pas aligné avec ces caractéristiques (#2 Autres). La somme de ces deux éléments conduit à un investissement à 100% dans les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables (#1B Autres caractéristiques E/S).



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

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

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

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables ayant des objectifs environnementaux ou sociaux;
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Les activités alignées sur la taxinomie 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 bénéficiaires des investissements.

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

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

Non applicable. Le prospectus du produit financier ne permet pas l'investissement dans des produits dérivés.



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

Le produit financier peut investir dans des activités économiques durables sur le plan environnemental, néanmoins les investissements 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. Le produit financier s'engage à un alignement de 0% avec la Taxonomie européenne.

- **Le produit financier investit-il dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxonomie de l'UE ?**

OUI

Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire

NON

Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxonomie de l'UE. Etant 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.

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.



Le symbole représente des investissements durables avec un objectif environnemental qui ne tient pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxonomie de l'UE.

• **Quelle est la proportion minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes ?**

La part minimale d'investissements dans les activités transitoires et habilitantes au sens du Règlement européen sur la taxonomie est de 0 % pour les activités transitoires et de 0 % pour les activités habilitantes.



Quelle est la proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxonomie de l'UE ?

L'OPCVM LYSIS ESG THEMATICIS n'a pas pour objectif de réaliser des investissements durables.



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

L'OPCVM LYSIS ESG THEMATICIS n'a pas pour objectif de réaliser des investissements durables.



Quels sont les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle est leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquent-elles à eux ?

Les investissements compris dans la catégorie « #2 Autres » sont les OPC qui ne sont pas couverts par une analyse ESG ainsi que les liquidités. Ces OPC comme les liquidités ne présentent aucune garantie environnementale ou sociale. Néanmoins, ces OPC respectent tous le socle commun d'exclusion de notre société de gestion, assurant ainsi le gage d'un minimum de principes ESG et leur sélection se fait dans le respect des bornes d'allocation prévues au prospectus.



Un indice spécifique est-il été désigné comme indice de référence pour déterminer si ce produit financier est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet ?

Non applicable

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

Non applicable

- ***Comment l'alignement de la stratégie d'investissement sur la méthodologie de l'indice est-il à tout moment garanti ?***

Non applicable

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

Non applicable

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

Non applicable

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



Où puis-je trouver en ligne davantage d'informations spécifiques au produit ?

De plus amples informations sur le produit sont accessibles sur le site internet :

L'ensemble des documents d'information concernant l'approche extra-financière du produit sont accessibles via le site internet www.tailor-am.com, rubrique « ESG ». Les investisseurs peuvent trouver des informations régulièrement mises à jour sur les critères extra-financiers pris en compte (liste non exhaustive) :

- Politique d'intégration des risques de durabilité ;
- Politique d'exclusions et de gestion des controverses ;
- Code de transparence.

Par ailleurs, des informations complémentaires sur le fonds et notamment sa documentation réglementaire sont disponibles via le site internet www.tailor-am.com, rubrique « Nos fonds ».