

Informations précontractuelles pour les produits financiers visés à l'Article 8, alinéas 1, 2 & 2a, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, 1^{er} alinéa, du Règlement (UE) 2020/852

Dénomination du Produit :
OCTO Crédit Court Terme

Identifiant d'entité juridique :
9695004FWUAVVSVYFX20

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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

| <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Oui | <input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> Non |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <input type="checkbox"/> Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif environnemental : ___% <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE | <input type="checkbox"/> Il promeut des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bine qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il contiendra une proportion minimale de ___% d'investissements durables <input type="checkbox"/> 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 <input type="checkbox"/> 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 <input type="checkbox"/> avec un objectif social |
| <input type="checkbox"/> Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif social : ___% | <input checked="" type="checkbox"/> Il promeut des caractéristiques E/S, mais ne réalisera 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 de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le Règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur un 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 taxinomie



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

A l'instar de l'ensemble des produits de la Gamme développée par AMPLÉGEST, ce produit particulier veut éviter toute exposition à des secteurs ou entreprises dont la nature ou la stratégie sont susceptibles de générer des risques environnementaux, sociaux ou au regard des droits fondamentaux graves ou trop importants pour être susceptibles d'être compensés par une quelconque génération d'externalité positive. Ce produit :1. a pour objectif de contribuer à un objectif global de réduction de l'empreinte carbone/de diminution des émissions de gaz à effet de serre de l'activité économique, en d'autres termes

de contribuer à l'émergence de modèles économiques plus durables ; 2. cherche à promouvoir des acteurs du secteur privé associés à la réalisation des objectifs de développement durable tels qu'énoncés par les Nations Unies dans le cadre du Global Compact et de leur Agenda 2030 ; 3. et entend enfin participer à l'avancée des principes d'égalité femmes/hommes dans le secteur privé – en particulier au sein de ses structures managériales et de gouvernance.

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

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.

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

Ce produit financier s'est engagé à battre la performance d'un indice crédit composite, représentatif de son univers investissable, en termes d'intensité carbone (Scope 1 & 2) et en termes de participation des émetteurs qui sous-tendent ses investissements au Global Compact des Nations Unies. Enfin il s'est engagé à prêter attention à la décomposition femmes/hommes des conseils d'administration des mêmes émetteurs et à se comparer également sur ce point aux positions du même indice composite.

● **Quels sont les objectifs d'investissement durable que le produit financier entend partiellement réaliser et comment l'investissement durable contribue-t-il à ces objectifs ?**

Question sans objet, compte tenu des caractéristiques de ce produit.

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

Compte tenu du fait que ce produit n'a aucun objectif en termes d'investissements durables, les deux points ci-dessous sont sans objet.

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

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'UE 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'UE 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 et sociaux.

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 ?

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



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

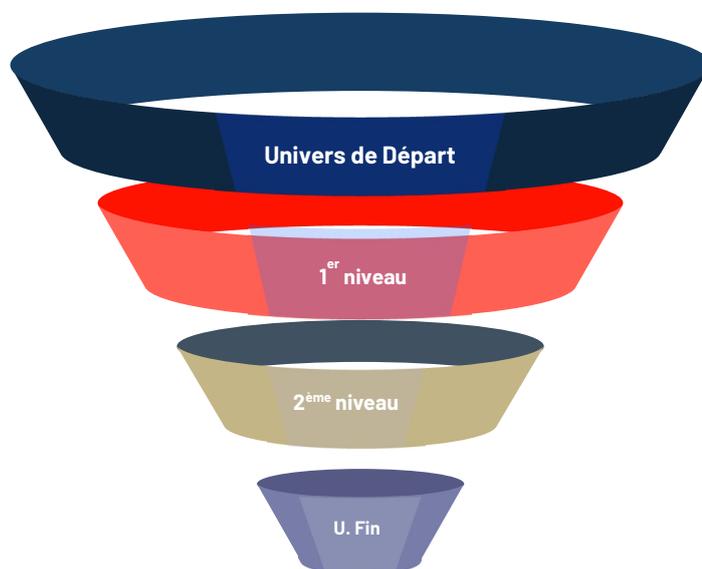
- Oui, certaines des principales incidences négatives sont prises en compte par ce produit financier, tant au travers des filtres d'exclusion ESG qui restreignent son univers investissable, qu'au travers de la méthodologie d'évaluation extra-financière utilisée pour approcher ces dimensions dans chacun des investissements qu'il entreprend.
- Non

Quelle stratégie ce produit financier suit-il ?

Ce produit suit une stratégie financière autant qu'extra-financière, en ce qu'il cherche à réaliser une performance financière supérieure à €+50pb et à battre la performance d'un indice de référence composite (50% iBovx Liquid High Yield Index / 50% iBovx Liquid Corporate Index) représentatif de l'univers investissable crédit euro(péen) en termes d'intensité carbone et de participation au Global Compact onusien.

- **Quels sont les éléments contraignants de la stratégie d'investissement utilisés pour sélectionner les investissements afin d'atteindre chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par ce produit financier ?**

La stratégie ESG de ce produit est construite sur une stratégie de réduction d'univers (approche en sélectivité) sur la base des différents filtres exposés ci-dessous, devant aboutir en permanence à une réduction d'au moins 20% d'un univers d'investissement large, cohérent avec l'univers qu'il est susceptible d'adresser.



EXCLUSIONS SUR CRITÈRES EXTRA-FINANCIERS

- Exclusion des émetteurs dont l'intensité carbone (T eq. CO₂/USDm de CA) > 1000
- Exclusion des émetteurs notés CCC par MSCI
- Exclusion des émetteurs bancaires/financiers non notés par MSCI ou de notation < BBB
- Exclusion des émetteurs domiciliés dans des pays de score CPI compris entre 45-55 dont la notation MSCI < BBB.

EXCLUSIONS ETHIQUES & NORMATIVES

- Exclusion de toutes les sociétés incluses dans la liste d'exclusion d'AMPEGEST (au titre de la politique d'exclusion générale de la société) ainsi que l'ensemble des compagnies aériennes.
- Exclusion de toutes les sociétés incluses dans les listes *Urgewald Global Coal & Global Oil Exit*.
- Exclusion de toutes les sociétés domiciliées dans des pays au score CPI (*Corruption Perceptions Index*) développé par *Transparency International* en deçà d'un score cible permettant de satisfaire en permanence aux exigences de réduction d'univers du Label ISR.

En outre à chaque instant la performance de ce produit se doit d'être supérieure à celle de son indice de référence en termes d'intensité carbone et d'engagement des entreprises bénéficiaires de ses investissements au sein du Global Compact de l'ONU.

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

Comme évoqué plus haut, l'application des filtres éthiques, normatifs ou plus classiquement extra-financiers doit aboutir à une réduction d'au moins 20% d'un univers d'investissement large défini à partir de critères cohérents avec l'univers adressable par ce produit.

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

Les pratiques de bonne gouvernance des sociétés bénéficiaires des investissements sont évaluées dans le cadre du pilier G de la méthodologie d'évaluation extra-financière Value 360 développée par AMPEGEST qui a été conçue pour être agnostique par rapport à la structure/typologie actionnariale des émetteurs, est en phase avec les travaux universitaires réalisés autour de la notion de « Gouvernance durable » et se focalise en particulier sur les enjeux de composition des Conseils d'Administration, d'Audit et de Politique/Pratiques anti-corruption.

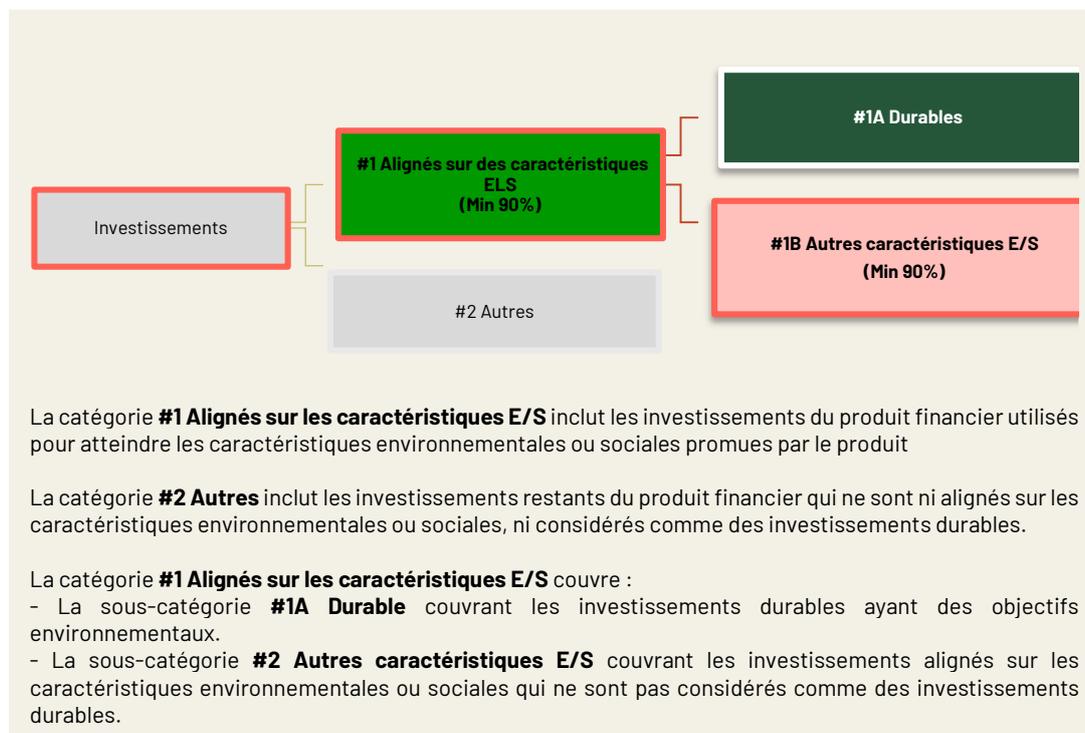


Quelle est l'allocation des actifs prévue pour ce produit financier ?

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 légales

Ce produit peut investir dans des titres de catégorie « Investment Grade », c'est-à-dire de notation supérieure à BBB- jusqu'à 100% de son actif ou dans des titres à caractère spéculatif « High Yield », de notation comprise entre BBB- et C à hauteur de 40% maximum de son actif. Il n'est pas contraint en termes de devises de ses investissements, étant entendu que son exposition aux risques de change ne saurait excéder 10% et que la durée de ces lignes ne saurait excéder 5 (pour une durée moyenne maximum de 2).

● **Comment l'utilisation de produits dérivés atteint-elle les caractéristiques**



environnementales ou sociales promues par le produit financier?

L'utilisation de produits dérivés dans le cadre de la gestion de ce produit n'a pas vocation à répondre à des ambitions environnementales ou sociales, mais vise à en optimiser la performance financière.



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

Ce produit n'ayant pas d'objectif d'investissement minimal dans des investissements durables, il n'a pas non plus d'objectif en termes d'alignement de ses investissements sur la taxinomie de l'UE.

● **Ce produit financier investit-il dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹?**

Oui :

Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie 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 nuisent pas de manière significative à un objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. Les critères complets pour les activités économiques liées au gaz fossile et à l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission européenne.

L'Allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques

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

Pour se conformer à la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent la limitation des émissions et le passage à l'énergie renouvelable ou aux combustibles à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères incluent des règles exhaustives de sécurité et de gestion des déchets

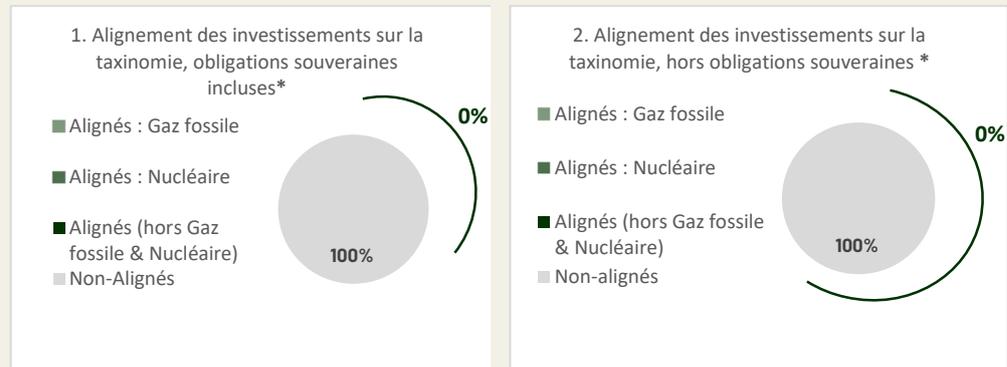
Les **Activités habilitantes** permettent à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental

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

renvoie à 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 taxinomie de l'UE

 Non

Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements 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 est la part minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes ?

Ce produit n'ayant pas d'objectif d'investissement minimal dans des investissements durables ayant un objectif environnemental, il n'a pas non plus d'objectif en termes d'alignement de ses investissements sur les catégories définies dans le cadre de la taxinomie de l'Union européenne, quelles qu'elles puissent être.



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

Ce produit n'ayant pas d'objectif d'investissement minimal dans des investissements durables, il n'a pas non plus d'objectif en termes d'investissements durables ayant un objectif environnemental mais ne seraient pas alignés sur la taxinomie de l'UE.



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

Ce produit n'ayant pas d'objectif d'investissement minimal dans des investissements durables, il n'en a pas davantage en termes d'investissements durables sur le plan social.



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

La catégorie #A2 renvoie à la part d'investissements n'ayant pas fait l'objet d'une analyse extra-financière, ne justifiant pas d'une notation financière ou au bénéfice d'une décision favorable et dûment motivée du Comité ESG d'AMPLEGEST (dès lors que leur situation l'imposait). Ils ne sauraient cependant en aucun cas déroger à la politique d'exclusion générale d'AMPLEGEST dont l'objectif est d'assurer qu'aucune des sociétés bénéficiant des investissements de ce produit poursuive des activités susceptibles de générer des externalités négatives environnementales ou sociales trop importantes pour pouvoir être compensées.



Existe-t-il un indice spécifique désigné comme indice de référence afin de déterminer si ce produit financier est aligné avec les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet ?

La performance extra-financière de ce produit est évaluée à l'aune de celle d'un indice composite représentatif de son univers investissable, mais qui n'emporte aucune caractéristique extra-financière particulière.

- **Comment l'indice de référence est-il continuellement aligné avec chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le produit financier ?**

Sans objet au regard du commentaire introductif à cette section.

- **Comment l'alignement de la stratégie d'investissement avec la méthodologie de l'indice est-il assuré en continu ?**

Sans objet au regard du commentaire introductif à cette section.

- **En quoi l'indice de référence désigné diffère-t-il d'un indice représentatif (global) de marché ?**

Il n'en diffère aucunement.

- **Où puis-je trouver la méthodologie utilisée pour le calcul de l'indice de référence désigné ?**

Comme explicité plus haut et dans l'ensemble de la documentation de ce fonds disponible sur le site internet de la société, l'indice de référence de ce produit en matière financière est un indice composite 50% iBoxx Liquid Corporate EUR Index / 50% iBoxx Liquid High Yield EUR.



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

Le site www.amplegest.com reprend l'ensemble des éléments publics relatifs à la démarche d'investisseur responsable d'AMPLEGEST ainsi que l'ensemble de la documentation réglementaire de ce produit.