

**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 **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne 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.

**Dénomination du produit : AXA Selection AllianceBernstein Dynamic Diversified (« le Compartiment »)**

**Identifiant d'entité juridique : 5493003T4LALHALXSN53**

## 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 ayant un objectif environnemental : \_\_\_%



dans des activités qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif social : \_\_\_%



Il promeut des caractéristiques environnementales et 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 taxinomie de l'UE



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



ayant un objectif social



Il promeut des caractéristiques E/S, mais ne réalisera pas d'investissements durables



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

AXA Selection AllianceBernstein Dynamic Diversified poursuit une stratégie d'investissement qui tient compte de certaines caractéristiques environnementales et sociales de la manière envisagée par l'article 8 du RGPD, mais n'a pas pour objectif un investissement durable au sens au sens de ce terme selon le RGPD. Aucun indice n'a été

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

désigné pour AXA Selection AllianceBernstein Dynamic Diversified comme indice de référence aux fins du SFDR.

L'application de la méthodologie propriétaire susmentionnée permet à AXA Selection AllianceBernstein Dynamic Diversified de promouvoir pour atténuer le changement climatique et faciliter l'adaptation à ses incidences, en tant que caractéristiques environnementales, ainsi que le bien-être et la santé et la sécurité des employés, en tant que caractéristiques sociales.

Veuillez consulter la réponse à la dernière question de la présente annexe pour obtenir des liens vers des informations complémentaires.

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

Le Gestionnaire effectue une évaluation annuelle de la justification de la classification du Gestionnaire d'investissement au titre de l'Article 8 du SFDR. Cette justification est présentée au Forum d'investissement responsable du Gestionnaire, qui est ouvert à tous les membres de l'équipe d'investissement et de l'équipe de diligence opérationnelle, où elle est évaluée et remise en cause en vue de validation.

La Société de gestion réalise également une due diligence ESG régulière de la méthodologie interne utilisé par le Gestionnaire d'investissement désigné pour procéder à son allocation du Compartiment. Cette due diligence comprend la réalisation du questionnaire ESG propre à la Société de gestion lors du processus initial de sélection par les Gestionnaires d'investissement désignés qui couvre ce qui suit :

- Politique et gouvernance ESG ;
- Intégration des facteurs ESG aux investissements ;
- Engagement et gestion (« stewardship ») ; et
- Risque et communication ESG.

Les réponses sont évaluées sur la base de critères de notations internes et une notation ESG combinée est calculée et ensuite passée en revue et remise en question par les membres expérimentés de l'équipe d'investissement. Tout gestionnaire d'investissement doté d'une notation inférieure au seuil de notation ESG minimum est exclu du processus de sélection. Le même processus est répété à intervalles réguliers par la suite afin de vérifier que chaque Gestionnaire d'investissement désigné continue de promouvoir les caractéristiques environnementales et/ou sociales.

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

Non applicable.



Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

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

Non applicable.

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

Non applicable.

*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 ? Description détaillée :*

Non applicable.

*La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.*

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

*Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.*



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

Oui

Le Fonds n'a pas réussi à parvenir à un niveau de détail suffisant d'évaluation des principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité en raison de la difficulté actuelle d'obtenir des données fiables.

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 stratégie d'investissement ce produit financier suit-il ?

La société de gestion a délégué les fonctions d'investissement et de réinvestissement des actifs d'AXA Selection AllianceBernstein Dynamic Diversified à AllianceBernstein, L.P, conformément aux termes d'une convention de gestion financière (la « Convention »). La Convention prévoit qu'AllianceBernstein, L.P gèrera les actifs d'AXA Selection AllianceBernstein Dynamic Diversified conformément aux objectifs et politiques d'investissement décrits dans le présent Supplément, sous la supervision et le contrôle de la société de gestion.

L'objectif d'investissement du Fonds AXA Selection AllianceBernstein Dynamic Diversified est de chercher à maximiser le rendement total.

Le Fonds AXA Selection AllianceBernstein Dynamic Diversified fait l'objet d'une gestion active. Le Compartiment AXA Selection AllianceBernstein Dynamic Diversified investit dans un portefeuille mondial diversifié de titres et d'autres instruments financiers, comprenant des instruments financiers dérivés (« Dérivés »), qui fournissent des expositions d'investissement à un éventail de catégories d'actifs.

Dans le cadre de l'objectif d'investissement, les investissements du Fonds AXA Selection AllianceBernstein Dynamic Diversified seront sélectionnés sur la base de l'évaluation faite par le Gestionnaire d'Investissement des conditions de marché (positives ou négatives) à tout moment et en vue de réagir à ou de tirer profit de ces conditions de marché. Pour atteindre l'objectif d'investissement, une stratégie dynamique interne d'allocation des actifs sera utilisée afin d'adapter les différentes expositions du Compartiment AXA Selection AllianceBernstein Dynamic Diversified en vue d'atteindre un profil de risque/rendement optimal à un moment donné.

### ● **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 ?**

AXA Selection AllianceBernstein Dynamic Diversified promeut des caractéristiques environnementales et sociales par la mise en œuvre de la méthodologie propriétaire du Gestionnaire d'investissement, qui intègre les caractéristiques ESG dans le processus d'investissement (y compris la recherche et l'analyse d'investissement), en veillant à ce que les risques et opportunités ESG soient identifiés, évalués et intégrés dans ses décisions d'investissement et son suivi, dont les détails sont exposés dans la section « Finance durable » du Prospectus.

La promotion des caractéristiques environnementales et sociales est accomplie à la fois par l'intégration des caractéristiques ESG dans tous les aspects du processus de décision d'investissement, en évaluant l'impact d'un investissement cible par rapport à l'ESG, et par un engagement étendu avec, entre autres, les émetteurs et les gouvernements pour encourager l'action et le progrès.

Un aspect clé de l'intégration et de la promotion des caractéristiques ESG est l'évaluation continue par le Gestionnaire d'investissement de l'importance et de l'impact des risques de durabilité qui, s'ils se produisaient, pourraient avoir un impact négatif important sur AXA Selection AllianceBernstein Dynamic Diversified. Lorsqu'il prend ses décisions d'investissement, le Gestionnaire d'Investissement évalue les émetteurs cibles afin de s'assurer qu'ils sont en phase avec les caractéristiques environnementales et/ou sociales pertinentes

qu'AXA Selection AllianceBernstein Dynamic Diversified cherche à promouvoir.

Le Gestionnaire d'Investissement rédigera périodiquement des « Rapports d'Engagement » résumant les engagements des émetteurs et leurs résultats. Le Gestionnaire d'investissement estime qu'il est essentiel d'intégrer les caractéristiques ESG dans sa recherche et de documenter l'engagement et les conclusions, ce qui permet à la stratégie d'investissement d'être fructueuse.

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

Il n'existe pas d'engagement sur un taux minimum.

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

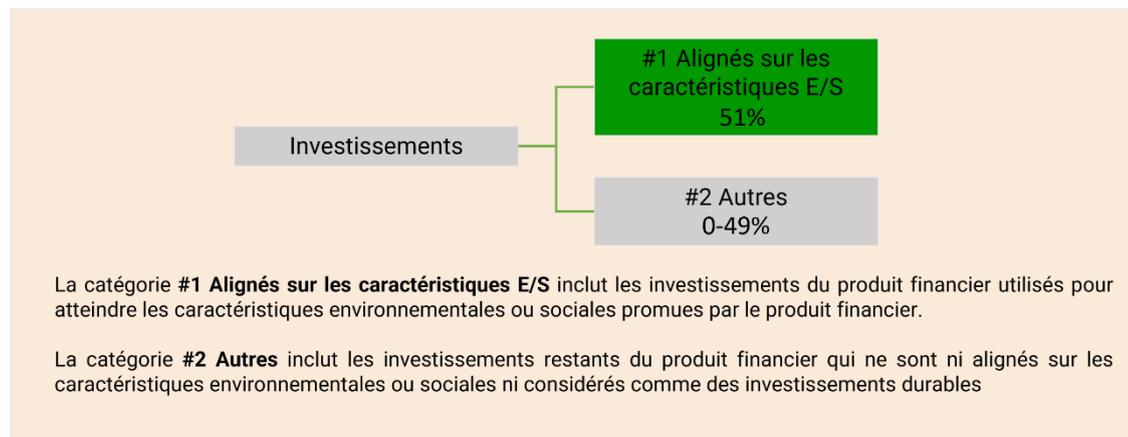
Le Gestionnaire d'investissement a développé une Politique de bonne gouvernance utilisant une conjugaison de sources de données externes et internes ainsi que des évaluations et des notations basées sur des critères de gouvernance spécifiques, y compris de solides structures de gestion, les relations avec les employés, la rémunération du personnel et la conformité avec la législation fiscale. Les indicateurs de gouvernance spécifiques incluent les principes du Pacte mondial des Nations Unies (« UN Global Compact ») et les controverses associées aux critères de gouvernance. La Politique de bonne gouvernance qui précède est soumise et dépend de la disponibilité des données.

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 l'allocation des actifs prévue pour ce produit financier ?

Le Compartiment AXA Selection AllianceBernstein Dynamic Diversified investit dans un portefeuille mondial diversifié de titres et d'autres instruments financiers, comprenant des instruments financiers dérivés (« Dérivés »), qui fournissent des expositions d'investissement à un éventail de catégories d'actifs. Le Compartiment prévoit d'allouer un minimum de 51% à des investissements alignés sur les caractéristiques E/S.



### ● **Comment l'utilisation de produits dérivés atteint-elle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

Le Compartiment peut utiliser les produits dérivés à des fins de couverture, de gestion efficace de portefeuille et à d'autres fins d'investissement. S'agissant des produits dérivés utilisés à d'autres fins d'investissement, leur exposition peut porter sur ces titres censés promouvoir des caractéristiques économiques et sociales.

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

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

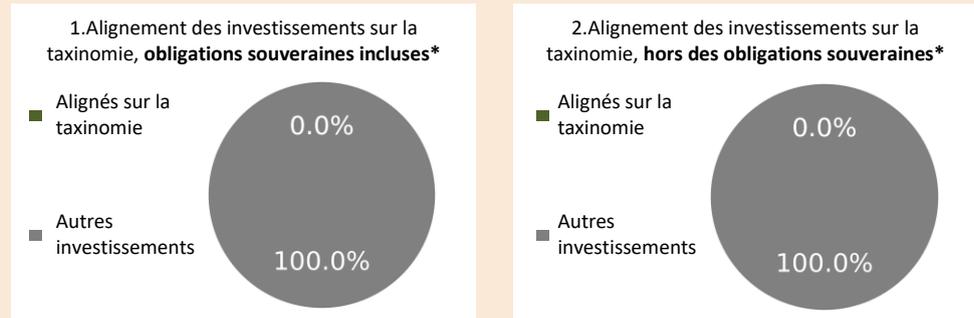
- **Du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ; des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **Des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.



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

0%

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 ?

0%

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.

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 taxinomie de l'UE.



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

0%



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

0%



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

Cela inclut ce qui suit :

- Les titres dont le Gestionnaire d'investissement pense qu'ils peuvent être détenus par le Compartiment afin d'atteindre son objectif d'investissement, mais qui ne sont pas censés promouvoir les caractéristiques économiques et sociales, tel que décrit ci-dessus, sous réserve de la satisfaction de la Politique

de bonne gouvernance du Gestionnaire d'investissement.

- La trésorerie et les équivalents de trésorerie détenus à des fins de liquidité et de gestion du risque ou à des fins de gestion de la garantie.
- Les produits dérivés utilisés aux fins décrites dans la section « Utilisation des produits dérivés » du supplément du Compartiment. L'exposition aux titres qui encouragent la promotion des caractéristiques environnementales et sociales sera présentée dans le point 1 Aligné avec les caractéristiques environnementales et sociales

Pour ces actifs, il n'existe pas de mesures minimales de protection au niveau environnemental ou social.



### **Un indice spécifique a-t-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 en permanence aligné 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 garanti en permanence ?***

Non applicable.

- ***En quoi l'indice 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.



### **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 : <https://ie.architas.com/modal/sustainable-finance-disclosures-review-sfdr-policy/>

De plus amples informations sur les caractéristiques promues par le Compartiment sont disponibles à l'adresse suivante :

<https://www.alliancebernstein.com/corporate/management-company.htm>

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