

**Veröffentlichungen auf der Website gemäß Art. 10 Absatz 1 der Verordnung über
nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor für
Finanzprodukte gemäß Artikel 8**

ZUSAMMENFASSUNG

Name des Produkts:

AMUNDI PEA S&P US Industrials Screened
UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):

9695009HKFIX2X728481

Ohne nachhaltiges Anlageziel

Mit diesem Finanzprodukt werden ökologische oder soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen angestrebt.

Bei diesem Finanzprodukt besteht die Verpflichtung zu verantwortlichen Investitionen.

Ökologische oder soziale Merkmale des Finanzprodukts

Der Fonds bewirbt ökologische und/oder soziale Merkmale unter anderem durch die Nachbildung eines Referenzindex, der ein Umwelt-, Sozial- und Governance-Rating („ESG“) enthält. Durch einen Optimierungsprozess wird erreicht, dass der ESG-Score des S&P 500 Plus Industrials Enhanced Weighted & Screened Index (nachfolgend „Referenzindex“ oder „Index“) im Vergleich zum Parent-Index um mindestens 10 % höher ist.

- i. Ausschluss von Unternehmen, die insbesondere in den folgenden Geschäftsbereichen tätig sind: umstrittene Waffen, militärische Verträge, Kraftwerkskohle, Tabak, Ölsande und Schiefer, Schiefergas, arktische Bohrungen, arktisches Öl und Gas, Leichtwaffen, Energieerzeugung aus fossilen Brennstoffen
- ii. Ausschluss von Unternehmen, die als gegen den Global Compact der Vereinten Nationen verstoßend identifiziert wurden (basierend auf der vom Datenanbieter Sustainalytics festgelegten Methodik) oder nicht von Sustainalytics abgedeckt sind
- iii. Ausschluss von Unternehmen, für die der Datenanbieter Trucost die Kohlenstoffintensität nicht berechnen kann
- iv. Ausschluss von Unternehmen ohne S&P Global ESG-Score oder mit einem S&P Global ESG-Score unter den niedrigsten 5 % im Anlageuniversum
- v. Ausschluss von Unternehmen ohne S&P Global ESG-Umwelt-Score oder mit einem S&P Global ESG-Umwelt-Score unter den niedrigsten 5 % des Anlageuniversums
- vi. Ausschluss von kontroversen Unternehmen nach Maßgabe von S&P

vii. Optimierungsprozess, der darauf abzielt, den Kohlenstofffußabdruck im Vergleich zum Parent-Index um mindestens 30 % zu reduzieren und die S&P Global ESG-Scores im Vergleich zum Parent-Index um mindestens 10 % zu verbessern

Aufteilung der Investitionen

Mindestens 90 % der Wertpapiere und Instrumente des OGA unterliegen einer ESG-Analyse und erfüllen daher die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale in Übereinstimmung mit den verbindlichen Elementen der Anlagestrategie. Darüber hinaus verpflichtet sich der OGA, mindestens 1 % (auf Basis des Nettoinventarwerts) nachhaltige Investitionen zu halten, wie aus der nachstehenden Grafik ersichtlich.

Kontrolle, Methoden, Datenquellen und ihre Grenzen, Due Diligence und Engagement-Richtlinien

Alle ESG-Daten, unabhängig davon, ob sie extern oder intern verarbeitet werden, werden vom Geschäftsbereich Responsible Investment zentralisiert, der für die Qualitätskontrolle der verarbeiteten ESG-Daten verantwortlich ist. Diese Überwachung umfasst eine automatisierte Qualitätsprüfung sowie eine qualitative Überprüfung durch ESG-Analysten, die Spezialisten ihrer jeweiligen Sektoren sind. Die ESG-Scores werden monatlich im proprietären Amundi-Modul Stock Rating Integrator (SRI) aktualisiert.

Bei Amundi verwendete Nachhaltigkeitsindikatoren basieren auf proprietären Methoden. Diese Indikatoren werden im Portfoliomanagementsystem dauerhaft zur Verfügung gestellt, damit die Portfoliomanager die Auswirkungen ihrer Anlageentscheidungen beurteilen können.

Darüber hinaus sind diese Indikatoren im Kontrollrahmen von Amundi eingebettet, wobei die Verantwortlichkeiten aufgeteilt sind zwischen der ersten Kontrollebene, die von den Anlageteams selbst durchgeführt wird, und der zweiten Kontrollebene, die von den Risikoteams durchgeführt wird, die die Einhaltung der durch den Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale fortlaufend überwachen.

Das von Amundi zur Bestimmung des ESG-Scores verwendete ESG-Rating ist ein quantitativer ESG-Score, der auf sieben Bewertungen basiert, die von A (beste Bewertung) bis G (schlechteste Bewertung) reichen. In der ESG-Ratingskala von Amundi entsprechen die Wertpapiere auf der Ausschlussliste einer Bewertung von G. Die ESG-Performance der Emittenten wird global und auf Ebene der relevanten Kriterien im Vergleich zur durchschnittlichen Performance ihrer Branche bewertet, indem die drei ESG-Dimensionen kombiniert werden.

Die beim ESG-Rating von Amundi angewandte Methodik umfasst 38 Kriterien, die entweder generisch (für alle Unternehmen unabhängig von ihrer Tätigkeit) oder branchenspezifisch sein können. Die Kriterien werden nach Branchen gewichtet und ihre Auswirkungen auf den Ruf, die betriebliche Effizienz und die Einhaltung gesetzlicher Vorschriften des Emittenten berücksichtigt. Die ESG-Ratings von Amundi können global für die drei Dimensionen E, S und G oder einzeln für einen ökologischen oder sozialen Faktor ausgedrückt werden.

Die ESG-Scores von Amundi basieren auf dem ESG-Analyserahmen und der Scoring-Methodik von Amundi. Für ESG-Scores beziehen wir Daten aus folgenden Quellen: Moody, ISS-Oekom, MSCI und Sustainalytics.

Unsere methodischen Beschränkungen sind konstruktionsbedingt auf die Verwendung von ESG-Daten zurückzuführen. Die ESG-Datenlandschaft wird derzeit standardisiert, was sich auf die Datenqualität auswirken kann; auch die Datenabdeckung stellt eine Beschränkung dar. Die aktuellen und zukünftigen Vorschriften werden die Standardisierung der Berichterstattung und Offenlegungen durch Unternehmen, auf denen ESG-Daten beruhen, verbessern.

Wir sind uns dieser Beschränkungen bewusst, die wir durch eine Kombination von Ansätzen mindern.

Jeden Monat wird der ESG-Score gemäß der quantitativen Methodik von Amundi neu berechnet. Das Ergebnis dieser Berechnung wird dann von den ESG-Analysten geprüft, die auf der Grundlage verschiedener Prüfungen eine qualitative „Stichprobenkontrolle“ für ihre Branche durchführen.

Amundi engagiert sich bei Unternehmen, in die investiert wird oder werden könnte, auf Emittentenebene, unabhängig von der Art der gehaltenen Beteiligung (Aktien und Anleihen).