

**Produktinformationen zur Website nach Artikel 10 Absatz 1 der EU-
Offenlegungsverordnung für Teilfonds gemäß Artikel 9**

ZUSAMMENFASSUNG

Name des Produkts: Lyxor Euro Government Green
Bond (DR) UCITS ETF

Unternehmenskennung:
549300JJ88530HI0FM17

Nachhaltiges Investitionsziel des Finanzprodukts

Der Teilfonds wird passiv verwaltet. Sein Anlageziel besteht darin, den Solactive Euro Government Green Bond Index (der „Index“) nachzubilden, der das nachhaltige Anlageziel verfolgt, repräsentativ für die Wertentwicklung von Green Bonds mit Investment-Grade-Rating zu sein, die von Ländern der Europäischen Währungsunion ausgegeben werden. Green Bonds werden emittiert, um Projekte zu finanzieren, die eine positive ökologische Wirkung erzielen.

Konkret bedeutet dies, dass eine Anleihe von der Climate Bonds Initiative als „Green Bond“ betrachtet werden muss, um in den Index aufgenommen werden zu können. Die Climate Bonds Initiative ist eine auf Anleger ausgerichtete gemeinnützige Organisation, die groß angelegte Investitionen fördert, die zu einer kohlenstoffarmen und klimaresistenten Wirtschaft beitragen (weitere Informationen finden Sie auf der Website: <http://www.climatebonds.net/>). Die Climate Bonds Initiative hat die folgenden Kriterien entwickelt und umgesetzt, um Green Bonds zu definieren, die in den Index aufgenommen werden können:

i) Umweltbezogene (von den Emittenten selbst gekennzeichnete) Anleihen: Um für die Aufnahme in den Index zulässig zu sein, müssen Green Bonds von ihren Emittenten öffentlich als ökologisch vorteilhaft gekennzeichnet werden. Zu den gängigen zulässigen Kennzeichnungen gehören unter anderem „grün“, „klimabewusst“, „Klima“, „Umwelt“, „Kohlenstoff“, „Nachhaltigkeit“ und „ESG“ (Umwelt, Soziales und Governance). Der Emittent muss die Kennzeichnung oder die Beschreibung in einem öffentlichen Dokument verwenden, damit die Kennzeichnung gültig ist (z. B. in einer Pressemitteilung, in einer Erklärung, im Anleiheprospekt oder in unterstützenden Anleiheangebotsdokumenten).

ii) Zulässige Anleihestrukturen, u. a.:

- Asset-Linked-Strukturen oder „Use of Proceeds“-Anleihen, bei denen Erlöse aus dem Verkauf von Anleihen für zulässige grüne Projekte vorgesehen sind; und

- Asset-Backed-Strukturen, die sich zusammensetzen aus:

a. Projektanleihen, die zulässig sind, wenn sie durch ein grünes Projekt besichert sind und die Erlöse aus dem Verkauf von Anleihen ausschließlich zur Finanzierung desselben grünen Projekts verwendet werden; und

b. verbrieft Anleihen, die zulässig sind, wenn Erlöse in grüne Projekte oder Vermögenswerte fließen.

iii) Verwendung der Erlöse: Die Emittenten müssen sich verpflichten, die Erlöse aus dem Verkauf der Anleihe vollständig (abzüglich etwaiger Gebühren für Anleihevereinbarungen) zur Finanzierung zulässiger grüner Projekte oder Vermögenswerte zu verwenden. Beispielsweise können Anleihen, bei denen mehr als 5 % der Erlöse für „allgemeine Unternehmenszwecke“ oder Projekte verwendet werden, die nicht als grün definiert sind, oder Anleihen, bei denen die Erlöse auf verschiedene Projekte aufgeteilt werden sollen (z. B. eine ESG-Anleihe mit sozialen Projekten und separate grüne Projekte), nicht in den Index aufgenommen werden.

iv) Einhaltung der „Climate Bonds Taxonomy“: Die Erlöse einer zulässigen grünen Anleihe müssen zur Finanzierung von zulässigen grünen Vermögenswerten oder Projekten verwendet werden, die typischerweise mit einem der folgenden Sektoren zusammenhängen (wie in der „Climate Bonds Taxonomy“ beschrieben):

- Erneuerbare und alternative Energien;
- Energieeffizienz;
- kohlenstoffemissionsarmer Transport;
- nachhaltiges Wasser;
- Abfall, Recycling und Verschmutzung;
- nachhaltige Land- und Forstwirtschaft;
- klimaresistente Infrastruktur und Klimaanpassung.

Wie in der Climate Bonds Taxonomy näher beschrieben, können Bereiche der vorstehend genannten Sektoren ausgeschlossen werden (z. B. Energieeinsparungen bei der Gewinnung fossiler Brennstoffe für die Kategorie Energieeffizienz oder Deponie ohne Entgasung für die Kategorie Abfälle), und damit verbundene Anleihen können nicht in den Index aufgenommen werden.

Weitere Informationen finden Sie auf der Website <http://www.climatebonds.net/> und <https://www.climatebonds.net/standard/taxonomy>.

Aufteilung der Investitionen

Der Teilfonds verpflichtet sich, dauerhaft mindestens 90 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in Green Bonds anzulegen, aus denen sich der Index zusammensetzt (d. h. ein EMU Government Green Bond).

Der Teilfonds verpflichtet sich, mindestens 90 % an nachhaltigen Investitionen gemäß der nachstehenden Tabelle zu halten. Die nachhaltigen Investitionen des Teilfonds unterstützen Umweltziele.

Der geplante Anteil der anderen ökologischen Investitionen kann sich ändern, wenn die tatsächlichen Anteile an taxonomiekonformen Investitionen steigen.

Überwachung, Methoden, Datenquellen, Beschränkungen hinsichtlich der Methoden und Daten, Sorgfaltspflicht und Mitwirkungspolitik

Alle extern oder intern verarbeiteten ESG-Daten werden vom Geschäftsbereich verantwortungsvolles Investieren zentralisiert, der für die Qualitätskontrolle der Inputs und verarbeiteten ESG-Outputs verantwortlich ist. Diese Überwachung umfasst eine automatisierte Qualitätsprüfung sowie eine qualitative Prüfung durch ESG-Analysten, die Spezialisten ihrer Sektoren sind. Die ESG-Scores werden monatlich im Rahmen des proprietären Amundi-Moduls Stock Rating Integrator (SRI) aktualisiert.

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

Darüber hinaus sind diese Indikatoren in den Kontrollrahmen von Amundi eingebettet, wobei die Verantwortlichkeiten zwischen der ersten Kontrollebene, die von den Anlageteams selbst durchgeführt wird, und der zweiten Kontrollebene, die von den Risikoteams durchgeführt wird, aufgeteilt sind, die die Einhaltung des nachhaltigen Investitionsziels des Fonds fortlaufend überwachen.

Das von Amundi zur Bestimmung des ESG-Scores verwendete ESG-Rating ist ein quantitativer ESG-Score, der sich in sieben Stufen von A (beste Bewertung) bis G (schlechteste Bewertung) unterteilt. In der Amundi ESG-Ratingskala entsprechen die Wertpapiere der Ausschlussliste einem G. Bei Unternehmensemittenten wird die ESG-Performance durch den Vergleich mit der durchschnittlichen Performance der Branche durch die Kombination der drei ESG-Dimensionen auf globaler und relevanter Kriterienebene bewertet.

Die von Amundi angewandte ESG-Rating-Methodik verwendet 38 Kriterien, die entweder generisch (für alle Unternehmen unabhängig von ihrer Tätigkeit gleich) oder sektorspezifisch sind, die nach Sektoren gewichtet und hinsichtlich ihrer Auswirkungen auf den Ruf, die betriebliche Effizienz und Vorschriften in Bezug auf einen Emittenten berücksichtigt werden. Die ESG-Ratings von Amundi werden wahrscheinlich global für die drei Dimensionen E, S und G oder einzeln für einen ökologischen oder sozialen Faktor ausgedrückt

Die ESG-Scores von Amundi basieren auf dem ESG-Analyserahmen und der Scoring-Methodik von Amundi. Wir beziehen Daten aus den folgenden Quellen für ESG-Scores: 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 ist eine Beschränkung. Die aktuelle und zukünftige Regulierung wird die standardisierte Berichterstattung und die Offenlegung von Unternehmensdaten, auf die ESG-Daten angewiesen sind, 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 überprüft, die auf der Grundlage verschiedener Prüfungen eine qualitative „Stichprobenkontrolle“ für ihren Sektor durchführen.

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