

Produktinformationen auf der Internetseite gemäß Art. 10 Abs. 1 der Verordnung über die Offenlegung von Informationen zu nachhaltigen Finanzprodukten für Art. Teilfonds gemäß Artikel 8

ZUSAMMENFASSUNG

Name des Produkts:

Amundi S&P 500 Equal Weight ESG Leaders UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):

2138007M60EXDENVTF82

Kein nachhaltiges Investitionsziel

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

Dieses Finanzprodukt verpflichtet sich zu nachhaltigen Investitionen.

Ökologische oder soziale Merkmale des Finanzprodukts

Der Teilfonds strebt die Bewerbung der folgenden ökologischen und sozialen Merkmale an:

- 1) Verringerung der Produktion umstrittener und nuklearer Waffen;
- 2) Verringerung der Umweltschäden durch Ölsande, Kraftwerkskohle und unkonventionelle Öl- und Gasgeschäftsaktivitäten; und
- 3) Verringerung des sozialen Schadens, der sich aus dem Arbeitsmanagement oder der Geschäftsethik ergibt.

Der Teilfonds bewirbt diese ökologischen und sozialen Merkmale unter anderem durch die Nachbildung des S&P 500 Equal Weight ESG+ Index (der „Index“), der ein Umwelt-, Sozial- und Governance-Rating („ESG“) enthält. Der Index wird ausgewählt und gewichtet, um seine ökologische und soziale Nachhaltigkeit zu verbessern, indem er eine Reihe von Filtern aus den Bereichen Umwelt und Soziales auf die Bestandteile des S&P 500 Equal Weight ESG Index (der „Parent-Index“) anwendet, um die Umweltziele zu erreichen im Vergleich zum Parent-Index, wie nachstehend detailliert beschrieben.

Der Index basiert auf einem „Best-in-Class-Ansatz“: Für den Aufbau des Index werden die am besten eingestuften Unternehmen in jedem Sektor ausgewählt.

„Best-in-Class“ ist ein Ansatz, bei dem führende oder leistungsstärkste Anlagen innerhalb eines Universums, eines Branchensektors oder einer Klasse ausgewählt werden. Unter Anwendung eines solchen Best-in-Class-Ansatzes verfolgt der Teilfonds einen besonders verbindlichen nicht-finanziellen

Ansatz, der die Reduktion des anfänglichen Anlageuniversums um mindestens 20 % (ausgedrückt in der Anzahl der Emittenten) ermöglicht.

Anteil der Investitionen

90 % der Wertpapiere und Instrumente des Teilfonds erfüllen die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale in Übereinstimmung mit den verbindlichen Elementen der Indexmethodik. Darüber hinaus besteht bei dem Teilfonds die Verpflichtung, mindestens 20 % an nachhaltigen Investitionen zu halten, so wie in dem unten stehenden Diagramm ersichtlich.

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 der vom Fonds geförderten ökologischen oder sozialen Merkmale 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 Umwelt- oder Sozialfaktor 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).