

Produktoffenlegung auf der Internetseite gemäß Art. 10(1) der Verordnung über die Offenlegung von Informationen zu nachhaltigen Finanzprodukten für Art. 8 Fonds

ZUSAMMENFASSUNG

Name: Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF
ein Teilfonds des Amundi

Unternehmenskennung: 529900GFNNJ8CI4K9B60

Kein nachhaltiges Investitionsziel

Dieser Teilfonds fördert ökologische oder soziale Eigenschaften, verfolgt aber nicht das Ziel einer nachhaltigen Investition.

Ökologische oder soziale Merkmale des Finanzprodukts

Der Teilfonds bewirbt ökologische und/oder soziale Merkmale, indem er den DAX® 50 ESG+ Net Return EUR (Net-Performance-Index) (der "Index") nachbildet. Der Teilfonds fördert ökologische und/oder soziale Merkmale, unter anderem durch die Integration des Umwelt-, Sozial- und Governance-Ratings ("ESG") des ESG-Bereichs des Datenanbieters International Shareholder Services Inc. („ISS-ESG“). Der DAX® 50 ESG+ Net Return EUR bildet die Wertentwicklung der 50 Unternehmen mit dem höchsten ESG-Ranking, die aus den 75 größten Unternehmen nach Streubesitz-Marktkapitalisierung des HDAX®-Index ausgewählt wurden, unter Verwendung von ESG-Ausschlussfiltern und Bewertungsmethoden aus dem ESG-Bereich des Datenanbieters International Shareholder Services Inc. („ISS-ESG“) sowie Berücksichtigung der Ausschlüsse, die in der jeweils geltenden Fassung des Artikel 12 Absatz 1 Buchstaben a) bis g) der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1818 der Kommission vom 17. Juli 2020 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2016/1011 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf Mindeststandards für EU-Referenzwerte für den klimabedingten Wandel und für Paris-abgestimmte EU-Referenzwerte („Delegierte Verordnung (EU) 2020/1818“) genannt sind.

Aufteilung der Investitionen

90 % der Wertpapiere und Instrumente des Teilfonds erfüllen die geförderten ökologischen oder sozialen Merkmale in Übereinstimmung mit den verbindlichen Elementen der Indexmethodik.

Darüber hin-aus verpflichtet sich der Teilfonds, einen Mindestanteil von 15 % an nachhaltigen Anlagen zu halten.

Überwachung, Methoden, Datenquellen und Limitationen, Due-Diligence und Engagement-Richtlinien

Alle ESG-Daten, die entweder extern oder intern verarbeitet werden, werden von der Abteilung für verantwortungsvolles Investieren, die für die Kontrolle der Qualität der Eingaben und der

verarbeiteten ESG-Ergebnisse verantwortlich ist, zentralisiert. Diese Überwachung umfasst eine automatische Qualitätsprüfung sowie eine qualitative Prüfung durch ESG-Analysten, die auf ihren jeweiligen Sektor spezialisiert sind. Die ESG-Bewertungen werden monatlich in dem von Amundi entwickelten Modul Stock Rating Integrator (SRI-Modul) aktualisiert.

Die von Amundi verwendeten Nachhaltigkeitsindikatoren beruhen auf proprietären Methoden. Diese Indikatoren werden kontinuierlich in das Portfoliomanagementsystem eingespeist, damit die Portfoliomanager die Auswirkungen ihrer Anlageentscheidungen bewerten können.

Darüber hinaus sind diese Indikatoren in den Kontrollrahmen von Amundi eingebettet, wobei die Zuständigkeiten zwischen der ersten Kontrollebene, die von den Investmentteams selbst durchgeführt wird, und der zweiten Kontrollebene, die von den Risikoteams durchgeführt wird, die die Einhaltung der vom Fonds geförderten ökologischen oder sozialen Merkmale laufend überwachen, aufgeteilt sind.

Das Amundi ESG-Rating, das zur Bestimmung des ESG-Scores verwendet wird, ist ein quantitativer ESG-Score, der in sieben Stufen von A (beste Note im Universum) bis G (schlechteste Note) übersetzt wird. In der Amundi ESG-Ratingskala entsprechen die Vermögensgegenstände/Wertpapiere, die auf der Amundi-eigenen Ausschlussliste stehen, einem G. Die ESG-Performance von Emittenten wird global und auf Ebene der relevanten Kriterien durch einen Vergleich mit der durchschnittlichen Performance ihrer Branche anhand der Kombination der drei ESG-Dimensionen bewertet.

Die zur Ermittlung des Amundi ESG-Ratings angewandte Methodik basiert auf 38 Kriterien, die entweder generisch (für alle Unternehmen unabhängig von ihrer Tätigkeit) oder sektorspezifisch, die je nach Sektor gewichtet und in Bezug auf ihre Auswirkungen auf den Ruf, die betriebliche Effizienz und die Regulierung eines Emittenten betrachtet werden, sind. Die ESG-Ratings von Amundi können global für die drei Dimensionen E, S und G oder individuell für jeden Umwelt- oder Sozialfaktor abgegeben werden.

Die ESG-Scores von Amundi werden anhand des ESG-Analyserahmens und der Scoring-Methodik von Amundi erstellt. Für die ESG-Bewertungen beziehen wir Daten aus den folgenden Quellen: Moody, ISS-Oekom, MSCI und Sustainalytics.

Die Einschränkungen unserer Methodik sind konstruktionsbedingt mit der Verwendung von ESG-Daten verbunden. Die ESG-Datenlandschaft wird derzeit standardisiert, was sich auf die Datenqualität auswirken kann; auch die Datenabdeckung stellt eine Einschränkung dar. Die derzeitige und künftige Regulierung wird die standardisierte Berichterstattung und die Unternehmensangaben, auf denen ESG-Daten beruhen, verbessern.

Wir sind uns dieser Einschränkungen bewusst, die wir durch eine Kombination von Ansätzen abmildern.

Jeden Monat werden die ESG-Scores nach der quantitativen Methodik von Amundi neu errechnet. Das Ergebnis dieser Berechnung wird dann von den ESG-Analysten überprüft, die eine qualitative "Stichprobenkontrolle" des Sektors auf der Grundlage verschiedener Prüfungen durchführen.

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