Produktinformationen zur Website nach Artikel 10 Absatz 1 der EU-Offenlegungsverordnung für Teilfonds gemäß Artikel 8

ZUSAMMENFASSUNG

Name des Produkts:

Amundi MSCI World SRI Climate Paris Aligned UCITS E

Unternehmenskennung:

213800X6RVCDPT2AIZ93

Kein nachhaltiges Investitionsziel

Der Teilfonds hat kein nachhaltiges Investitionsziel.

Der Teilfonds fördert ökologische und soziale Merkmale unter anderem durch die Nachbildung des MSCI World SRI Filtered PAB Index (der „Index“), der die Mindestanforderungen für EU Paris Aligned Benchmarks („EU PABs“ – Paris-abgestimmte EU-Referenzwerte) gemäß der Verordnung (EU) 2019/2089 zur Änderung der Verordnung (EU) 2016/1011 (die „Verordnung“) erfüllt.

Der Teilfonds strebt die Bewerbung der folgenden ökologischen und sozialen Merkmale an, verfolgt jedoch nicht das Ziel einer nachhaltigen Investition:

- 1) Verringerung der Kohlenstoffemissionsintensität;
- 2) Reduzierung der Treibhausgasemissionen;
- 3) Verringerung der Produktion umstrittener und nuklearer Waffen, Konventionswaffen und ziviler Schusswaffen; und
- 4) Verringerung der Umweltschäden durch Ölsande, Kraftwerkskohle und unkonventionelle Öl- und Gasgeschäftsaktivitäten.

Die Verordnung schlägt die Definition von Mindestanforderungen an die Methodik von „Paris-abgestimmten EU-Referenzwerten“ vor, die mit den Zielen des Übereinkommens von Paris in Einklang stehen würden. 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 MSCI World Index (der „Parent-Index“) anwendet, um die Umweltziele zu erreichen und den CO₂-Fußabdruck im Vergleich zum Parent-Index zu reduzieren, wie nachstehend detailliert beschrieben.

Die Indexmethodik richtet sich nach bestimmten Kriterien, wie z. B.:

- Eine Verringerung der Treibhausgasintensität (THG) im Verhältnis zum Parent-Index um mindestens 50 %; und
- Eine Mindest-Selbstdekarbonisierungsrate der Treibhausgasemissionsintensität gemäß dem vom Intergovernmental Panel on Climate Change („IPCC“) angestrebten ehrgeizigsten 1,5 °C-Szenario, was einer Verringerung der Treibhausgasintensität um durchschnittlich mindestens 7 % pro Jahr entspricht.

Ökologische oder soziale Merkmale des Finanzprodukts

Die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen wurden berücksichtigt, wie im ersten Filter für nicht erhebliche Beeinträchtigungen (DNSH) oben beschrieben:

Der erste DNSH-Filter stützt sich auf die Überwachung der obligatorischen Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Anhang 1, Tabelle 1 der Technischen Regulierungsstandards, wenn über die Kombination der folgenden Indikatoren und spezifischen Schwellenwerte oder Regeln robuste Daten verfügbar sind:

- Sie haben eine CO₂-Intensität, die im Vergleich zu anderen Unternehmen innerhalb ihres Sektors nicht zum letzten Dezil gehört (gilt nur für Sektoren mit hoher Intensität), und
- sie haben eine Diversität im Verwaltungsrat, die im Vergleich zu anderen Unternehmen in ihrem Sektor nicht zum letzten Dezil gehört, und
- sie wurden von jeglichem Fehlverhalten in Bezug auf Arbeitsbedingungen und Menschenrechte freigesprochen, und
- sie wurden von jeglichem Fehlverhalten in Bezug auf Biodiversität und Umweltverschmutzung freigesprochen.

Amundi berücksichtigt bereits bestimmte wesentliche nachteilige Auswirkungen im Rahmen seiner Ausschlusspolitik als Teil der Responsible Investment Policy von Amundi. Diese Ausschlüsse, die zusätzlich zu den oben beschriebenen Tests gelten, decken die folgenden Themen ab: Ausschlüsse bei umstrittenen Waffen, Verstöße gegen die UN Global Compact Prinzipien, Kohle und Tabak.

Aufteilung der Investitionen

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

Bei dem Teilfonds besteht darüber hinaus die Verpflichtung, mindestens 30 % an nachhaltigen Investitionen zu halten.

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).