

**Oplysninger om produkter på hjemmesiden i henhold til paragraf 10, stk. 1, i forordningen om offentliggørelse af oplysninger om bæredygtige finanser for paragraf 8 underfonde**

**OPSUMMERING**

**Produktnavn:**  
AMUNDI S&P 500 SCREENED UCITS ETF

**Identifikator for juridisk enhed:**  
2138007NOUJ46G9POA93

### Intet bæredygtigt investeringsmål

Dette finansielle produkt fremmer miljømæssige eller sociale karakteristika, men har ikke bæredygtige investeringer som mål

Dette finansielle produkt forpligter sig til at foretage bæredygtige investeringer.

### Finansielle produkters miljømæssige eller sociale karakteristika

Underfonden søger at fremme følgende miljømæssige og sociale forhold:

- 1) reduktion af produktionen af kontroversielle våben og atomvåben, og
- 2) reduktion af miljøskader fra oliesand, termisk kul og ukonventionelle olie- og gasaktiviteter.

Afdelingen fremmer disse miljømæssige og sociale karakteristika gennem replicering af S&P 500 Scored & Screened+ Index (USD) NTR ("indekset"), der integrerer en vurdering af miljømæssige, sociale og ledelsesmæssige forhold ("ESG"). Indekset udvælges og vægtes for at forbedre dets miljømæssige og sociale bæredygtighed ved at anvende en række miljømæssige og sociale filtre på komponenterne i S&P 500 Index ("det overordnede indeks") med det formål at opfylde miljømæssige mål sammenlignet med det overordnede indeks som beskrevet nærmere nedenfor.

Indeksmetoden er opbygget ved hjælp af en "Best-in-class-tilgang": De bedst rangerede virksomheder i hver sektor udvælges til at udarbejde Indekset.

"Best-in-class" er en tilgang, hvor førende eller bedst præsterende investeringer udvælges inden for et område, en industrisektor eller en klasse. Ved hjælp af en sådan Best-in-class-tilgang følger underfonden en ekstrafinansiel tilgang, der gør det muligt at reducere det oprindelige investeringsunivers (udtrykt i antal udstedere) med mindst 20 %.

## Andel af investeringer

90 % af underfondens værdipapirer og instrumenter vil opfylde de promoverede miljømæssige eller sociale forhold i overensstemmelse med de bindende elementer i indeksets metodologi.

Desuden forpligter underfonden sig til at have mindst 15 % bæredygtige investeringer i henhold til nedenstående diagram.

## Overvågning, metoder, datakilder og deres begrænsninger, due diligence og engagementspolitikker

Alle ESG-data, enten eksternt eller internt behandlet, centraliseres af Responsible Investment Business line, som er ansvarlig for at kontrollere kvaliteten af input og behandlede ESG-output. Denne overvågning omfatter en automatiseret kvalitetskontrol samt en kvalitativ kontrol fra ESG-analytikere, der er specialister i deres sektorer. ESG-scoring opdateres månedligt i Amundis proprietære Stock Rating Integrator-modul (SRI).

Bæredygtighedsindikatorer, der anvendes i Amundi, er afhængige af proprietære metoder. Disse indikatorer gøres løbende tilgængelige i porteføljevaltningsystemet, så porteføljevalterne kan vurdere effekten af deres investeringsbeslutninger.

Endvidere er disse indikatorer integreret i Amundis kontrolramme med ansvarsfordeling mellem det første kontrolniveau, som investeringsteamet selv udfører, og det andet kontrolniveau, som udføres af risikogrupperne, som løbende overvåger overholdelsen af miljømæssige eller sociale karakteristika, som fonden fremmer.

Amundi ESG-vurderingen, der bruges til at bestemme ESG-scoren, er en kvantitativ ESG-score, der omsættes til syv ratings, der går fra A (det bedste scoreunivers) til G (det dårligste). I Amundi ESG-vurderingsskalaen svarer værdipapirerne på udelukkelseslisten til et G. For virksomheder, der udsteder værdipapirer, vurderes ESG-resultaterne globalt og på det relevante kriterieniveau ved sammenligning med branchegennemsnittet ved hjælp af en kombination af de tre ESG-dimensioner.

Den metode, der anvendes af Amundi ESG-vurderingen, anvender 38 kriterier, der enten er generiske (fælles for alle selskaber uanset deres aktivitet) eller sektorspecifikke, der vægtes efter sektor og overvejes i forhold til deres indvirkning på omdømme, driftseffektivitet og regler over for en udsteder. Amundi ESG-vurderinger vil sandsynligvis blive udtrykt globalt på de tre E-, S- og G-dimensioner eller individuelt på en miljømæssig eller social faktor.

Amundis ESG-scoring er baseret på Amundis ESG-analyseramme og -scoringmetode. Vi indhenter data fra følgende kilder til ESG-vurderinger: Moody, ISS-Oekom, MSCI og Sustainalytics.

Vores metodebegrænsninger er baseret på konstruktion forbundet med brugen af ESG-data. ESG-datalandskabet er i øjeblikket ved at blive standardiseret, hvilket kan påvirke datakvaliteten. Datadækning er også en begrænsning. Den nuværende og fremtidige lovgivning vil forbedre den standardiserede rapportering og de selskabsoplysninger, som ESG-data er afhængige af.

Vi er opmærksomme på disse begrænsninger, som vi afbøder ved en kombination af tilgange.

Hver måned genberegnes ESG-scoren i henhold til den kvantitative Amundi-metode. Resultatet af denne beregning gennemgås derefter af ESG-analytikerne, som udfører en kvalitativ "prøvekontrol" af sin sektor baseret på forskellige kontroller.

Amundi ansætter investerede eller potentielle investerede virksomheder på udstederniveau uanset beholdningstype (egenkapital og obligationer).