

Produktinformation på webbplatsen enligt art. 10(1) i förordningen om offentliggörande av information om hållbar finansiering för art. 8 delfonder

SAMMANFATTNING

Produktnamn:
Amundi S&P Global Banks ESG UCITS ETF

Identifieringskod för juridiska personer:
2138007KF76QTMYCGF91

Inga mål för hållbar investering

Delfonden strävar efter att främja följande miljömässiga och sociala egenskaper:

- 1) minskning av koldioxidintensiteten
- 2) minskning av produktionen av kontroversiella vapen och kärnvapen
- 3) minskning av miljöskador från oljesand, energikol och okonventionell olje- och gasverksamhet

Delfonden främjar dessa miljömässiga och sociala egenskaper genom att replikera S&P Developed Ex-Korea LargeMidCap Sustainability Enhanced Banks Index ("indexet") som innehåller ett ESG-betyg (miljö, samhälle och bolagsstyrning). Indexet väljs ut och viktas för att förbättra dess miljömässiga och sociala hållbarhet genom att tillämpa ett antal miljömässiga och sociala filter på beståndsdelarna i S&P Developed Ex-Korea LargeMidCap Banks Index ("Parent Index") för att uppfylla miljömålen och minska koldioxidavtrycket jämfört med Parent indexet enligt närmare beskrivning nedan.

Finansiella produkters miljörelaterade eller sociala egenskaper

Indikatorerna för negativa effekter har beaktats såsom beskrivs i det första DNSH-filtret ovan:

Det första DNSH-filtret övervakar obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa effekter i bilaga 1, tabell 1 i RTS där robusta data finns tillgängliga via kombinationen av följande indikatorer och specifika trösklar eller regler:

- Har en CO₂-intensitet som inte hör till den sista decilen jämfört med andra företag inom sin sektor (gäller endast högintensiva sektorer), och
- Har en styrelses mångfald som inte hör till den sista decilen jämfört med andra företag inom sin bransch, och
- Vara fri från eventuella kontroverser i fråga om arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter.
- Vara fri från eventuella kontroverser i fråga om biologisk mångfald och föroreningar

Amundi betraktar redan specifika principiella negativa effekter inom ramen för sin exkluderingspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa undantag, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, täcker följande ämnen: undantag från kontroversiella vapen, överträdelser av FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Andel investeringar

Övervakning, metoder, datakällor och deras begränsningar, due diligence och policyer för engagemang

All ESG-data, antingen externt eller internt behandlade, centraliseras av Responsible Investment Business-linjen, som ansvarar för att kontrollera kvaliteten på indata och bearbetade ESG-utdata. Denna övervakning omfattar en automatiserad kvalitetskontroll samt en kvalitativ kontroll från ESG-analytiker som är specialister inom sina sektorer. ESG-poängen uppdateras varje månad i Amundis egenutvecklade modul Stock Rating Integrator (SRI).

Hållbarhetsindikatorer som används inom Amundi bygger på egna metoder. Dessa indikatorer görs kontinuerligt tillgängliga i portföljhanteringssystemet så att portföljförvaltarna kan bedöma effekten av sina investeringsbeslut.

Dessutom är dessa indikatorer inbäddade i Amundis kontrollramverk, med ansvarsfördelning mellan den första nivån av kontroller som investeringsteamerna själva utför och den andra nivån av kontroller som utförs av riskteamerna, som kontinuerligt övervakar efterlevnaden av miljömässiga eller sociala egenskaper som främjas av fonden.

Amundi ESG-betyget som används för att fastställa ESG-poängen är ett ESG-kvantitativt betyg översatt till sju betyg, allt från A (universumet med de bästa betygen) till G (det sämsta). I Amundi ESG Rating-skalan motsvarar de värdepapper som tillhör exkluderingslistan ett G. För företagsemittenter bedöms ESG-prestanda globalt och på relevant kriterienivå i jämförelse med den genomsnittliga utvecklingen för dess bransch, genom kombinationen av de tre ESG måtten

Metodikerna som tillämpas av Amundi ESG-rating använder 38 kriterier som antingen är generiska (gemensamma för alla företag oavsett verksamhet) eller sektorspecifika som viktas efter sektor och beaktas i termer av deras inverkan på rykte, operativ effektivitet och regelverk avseende en emittent. Amundi ESG-betyg uttrycks sannolikt globalt på de tre E-, S- och G-dimensionerna eller individuellt på någon miljömässig eller social faktor

Amundis ESG-betyg bygger på Amundis ramverk för ESG-analys och poängmetod. Vi hämtar data från

följande källor för ESG-poäng: Moody, ISS-Oekom, MSCI och Sustainalytics.

Våra metodikbegränsningar är genom konstruktion kopplad till användning av ESG-data. ESG-datalandskapet håller för närvarande på att standardiseras, vilket kan påverka datakvaliteten. Datatäckningen är också en begränsning. Nuvarande och framtida regelverk kommer att förbättra standardiserad rapportering och företagsinformation som ESG-data är beroende av.

Vi är medvetna om dessa begränsningar som vi mildrar genom en kombination av tillvägagångssätt.

Varje månad omräknas ESG-betyget enligt Amundi kvantitativ metodik. Resultatet av denna beräkning granskas sedan av ESG-analytiker som utför en kvalitativ ”provtagningskontroll” av sin sektor baserat på olika kontroller.

Amundi anlitar investeringsobjekt eller potentiella investeringsobjekt på emittentnivå oavsett vilken typ av innehav som innehåses (eget kapital och obligationer).