

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 500 Equal Weight ESG Leaders UCITS ETF

Identifieringskod för juridiska personer:
2138007M60EXDENVTF82

Inga mål för hållbar investering

Denna finansiella produkt främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper, men har inte en hållbar investering som sitt mål.

Denna finansiella produkt förbinder sig att göra hållbara investeringar.

Den finansiella produktens miljörelaterade eller sociala egenskaper

Delfonden strävar efter att främja följande miljömässiga och sociala egenskaper:

- 1) minskning av produktionen av kontroversiella vapen och kärnvapen;
- 2) minskning av miljöskador från oljesand, energikol och okonventionell olje- och gasverksamhet; och
- 3) minskning av social skada som härrör från arbetsledning eller affärsetik.

Delfonden främjar dessa miljömässiga och sociala egenskaper genom att replikera S&P 500 Equal Weight ESG+ Index ("indexet") som innehåller ett ESG-betyg (miljö, socialt ansvar 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 500 Equal Weight Index ("Parent Index") för att uppfylla miljömålen jämfört med Parent index enligt närmare beskrivning nedan.

Indexet är uppbyggt enligt en "bäst-i-klassen-metod": de företag som rankas bäst i varje sektor väljs ut för att konstruera indexet.

"Bäst i klassen" är en metod där ledande eller bäst presterande investeringar väljs ut inom ett universum, en industrisektor eller en klass. Med hjälp av en sådan "best-in-class"-strategi följer delfonden ett extrafinansiellt tillvägagångssätt med betydande engagemang som möjliggör en minskning med minst 20 % av det inledande investeringsområdet (uttryckt i antal emittenter).

Andel investeringar

90 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla de främjade miljömässiga eller sociala egenskaperna i enlighet med de bindande elementen i indexmetodikerna. Dessutom åtar sig delfonden att ha minst 20 % hållbara investeringar enligt tabellen nedan.

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 miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av fonden.

Amundi ESG-betyget som används för att fastställa ESG-poängen är ett kvantitativt ESG-betyg uttryckt i sju betygsgrader, 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 miljörelaterad 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 kopplade 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 Amundis kvantitativa metod. 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 innehas (eget kapital och obligationer).